

II

(Ikke-lovgivningsmæssige retsakter)

FORORDNINGER

KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2023/894

af 4. april 2023

om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for anvendelsen af Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF for så vidt angår skemaerne til forsikrings- og genforsikringsselskabers indberetning til deres tilsynsmyndigheder af oplysninger, der er nødvendige for udførelsen af tilsyn, og om ophævelse af gennemførelsesforordning (EU) 2015/2450

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II) ⁽¹⁾, særlig artikel 35, stk. 10, tredje afsnit, artikel 244, stk. 6, tredje afsnit, og artikel 245, stk. 6, andet afsnit, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) Oplysninger, der modtages gennem indberetning, er afgørende for risikobaseret tilsyn og beskyttelse af forsikringstagere. Med henblik herpå er det nødvendigt, at tilsynsmyndighederne får relevante data inden for rimelige tidsfrister. For at sikre, at indberetningskravene holdes ajour og afspejler nye risici og ny praksis, er det nødvendigt i væsentlig grad at revidere indberetningsskemaerne i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2450. Det kræver ændringer af en lang række skemaer, tilføjelse af nye skemaer og fjernelse af forældede skemaer. I betragtning af ændringernes omfang bør gennemførelsesforordning (EU) 2015/2450 ophæves.
- (2) Grænseoverskridende virksomhed er ikke i sig selv mere risikobetonet, men det tilføjer endnu et lag af kompleksitet. Et effektivt tilsyn bør sikre, at alle forsikringstagere og begunstigede behandles ens uanset nationalitet eller bopæl. Med henblik på at lette opfyldelsen af dette mål erstattes de eksisterende skemaer til grænseoverskridende aktivitet af nye indberetningsskemaer, der konsoliderer oplysningskravet, som omfatter oplysninger om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter både forsikringssted og risikoplacering.
- (3) Det er også nødvendigt at fastsætte et vist retligt minimumskrav med hensyn til omfanget af de oplysninger om risici i forbindelse med klimaændringer, der indberettes til tilsynsmyndighederne. Selskaberne bør give tilsynsmyndighederne et overblik over deres respektive andel af de investeringer, der er eksponeret for omstilling i forbindelse med klimaændringer og fysiske risici.
- (4) Der er mangel på detaljeringsgrad hvad angår oplysningerne om skadesforsikringsprodukter, hvilket påvirker beskyttelsen af forsikringstagerne negativt. Tilsynsmyndigheder bør derfor have entydige oplysninger om produkt-niveauekategorier. Hertil indføres der et nyt skema til analyse af skadesforsikringsforpligtelser til indberetning efter branche — med nogle få undtagelser, der indberettes efter produktkategori.

⁽¹⁾ EUT L 335 af 17.12.2009, s. 1.

- (5) Da forsikrings- eller genforsikringssselskaber i stigende grad udsteder forsikringer mod cyberrisici, bør tilsynsmyndigheder også tage højde for denne nye risiko i deres tilsynsaktiviteter. For at lette sådanne aktiviteter er der medtaget et nyt indberetningsskema vedrørende forsikring mod cyberrisici.
- (6) Som led i tilsynsprocessen er det vigtigt, at tilsynsmyndighederne er i stand til at overvåge, om de interne modeller er tilstrækkelige. Partielle og komplette interne modeller muliggør en bedre registrering af et selskabs individuelle risiko, og direktiv 2009/138/EF giver forsikrings- og genforsikringssselskaber mulighed for at anvende disse modeller til at fastsætte kapitalkrav uden de begrænsninger, der hidrører fra standardformlen. Vurderinger baseret på ikke-standardiserede oplysninger gør det dog vanskeligere at føre tilsyn. Tilsynsmyndighederne bør derfor drage fordel af nye skemaer og entydige instrukser, som understøtter en fornuftig dataproduktion.
- (7) Indberetningskravene bør ikke være uforholdsmæssigt byrdefulde for selskaberne. Med henblik herpå er det nødvendigt at præcisere, hvordan en række indberetningskrav finder anvendelse på en forholdsmæssig måde uden at bringe kvaliteten af de data, som selskaberne skal fremlægge, i fare.
- (8) Captive-forsikringssselskaber og captive-genforsikringssselskaber, som kun dækker risici i forbindelse med den industri- eller erhvervs-koncern, som de tilhører, har en særlig risikoprofil, der bør tages i betragtning ved fastlæggelsen af indberetningskravene. Captive-forsikringssselskaber og captive-genforsikringssselskaber bør derfor kunne drage fordel af specifikke risikobaserede indberetningsordninger.
- (9) Bestemmelserne i denne forordning er indbyrdes tæt forbundne, da de alle vedrører indberetning af oplysninger fra forsikrings- og genforsikringssselskaber og forsikrings- og genforsikringskoncerner til tilsynsmyndighederne. Af hensyn til sammenhængen mellem disse bestemmelser, som bør træde i kraft samtidigt, og for at de personer, som er omfattet af indberetningskravene, herunder investorer, der ikke er etableret i Unionen, lettere kan få en grundig forståelse af og samlet adgang til dem, er det hensigtsmæssigt at samle alle de ved artikel 35, stk. 10, artikel 244, stk. 6, og artikel 245, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF krævede gennemførelsesmæssige tekniske standarder i én enkelt forordning.
- (10) Nærværende forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Tilsynsmyndighed for Forsikrings- og Arbejdsmarkedspensionsordninger har forelagt Kommissionen.
- (11) Den Europæiske Tilsynsmyndighed for Forsikrings- og Arbejdsmarkedspensionsordninger har afholdt åbne offentlige høringer om det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt anmodet om en udtalelse fra interessentgruppen for forsikrings- og genforsikringsordninger, der er nedsat i henhold artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1094/2010 ⁽²⁾.
- (12) Selskaberne bør have tilstrækkelig tid til at gennemføre de ajourførte indberetningskrav. Forordningen bør derfor have en senere anvendelsesdato —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

KAPITEL I

SKEMAER TIL TILSYNSINDBERETNING

Artikel 1

Formater for tilsynsindberetning

Forsikrings- og genforsikringssselskaber, captive-forsikringssselskaber og captive-genforsikringssselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringssselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter oplysninger i overensstemmelse med denne forordning i de dataudvekslingsformater og fremstillinger, som tilsynsmyndigheden eller den koncerntilsynsførende har fastsat, idet de overholder følgende anvisninger:

- a) Datapunkter af typen »beløb« udtrykkes i enheder uden decimaler, med undtagelse af de oplysninger, der er omhandlet i skema S.06.02, S.08.01 og S.11.01 i bilag I og III til denne gennemførelsesforordning, hvor de udtrykkes i enheder med to decimaler.

⁽²⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1094/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Tilsynsmyndighed for Forsikrings- og Arbejdsmarkedspensionsordninger), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/79/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 48).

- b) Datapunkter af typen »procent« udtrykkes pr. enhed med fire decimaler.
- c) Datapunkter af typen »heltal« udtrykkes i enheder uden decimaler.
- d) Alle datapunkter udtrykkes som positive værdier, undtagen i følgende tilfælde:
 - i) datapunkterne er af modsat art i forhold til postens naturlige beløb
 - ii) datapunktets art giver mulighed for indberetning af positive og negative værdier
 - iii) der kræves et andet indberetningsformat i vejledningerne i det pågældende bilag.

Artikel 2

Indberetningsvaluta

1. Medmindre tilsynsmyndigheden kræver andet med henblik på denne gennemførelsesforordning, er indberetningsvalutaen følgende valuta:
 - a) for individuel indberetning: den valuta, der benyttes ved udarbejdelsen af forsikrings- eller genforsikringsselskabets regnskaber
 - b) for indberetning på koncernniveau: den valuta, der benyttes ved udarbejdelsen af koncernregnskabet.
2. Datapunkter af typen »beløb« angives i indberetningsvalutaen, hvilket kræver, at andre valutaer omregnes til indberetningsvalutaen, medmindre andet er fastsat i bilag II og III til denne gennemførelsesforordning.
3. Når værdien af et aktiv eller et passiv, der er denomineret i en anden valuta end indberetningsvalutaen, udtrykkes, omregner forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber værdien til indberetningsvalutaen, som hvis omregningen var sket til lukkekursen på den sidste dag, hvor den relevante kurs er tilgængelig i den indberetningsperiode, som aktivet eller passivet vedrører.
4. Når værdien af eventuelle indtægter eller udgifter udtrykkes, omregner forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber denne værdi til indberetningsvalutaen under anvendelse af samme konverteringsgrundlag som det, der anvendes i regnskabsmæssig henseende.
5. Når værdierne af historiske data, der er denomineret i en anden valuta end indberetningsvalutaen, udtrykkes, omregnes sådanne værdier vedrørende tidligere indberetningsperioder til indberetningsvalutaen baseret på lukkekursen på den sidste dag i indberetningsperioden, hvor omregningskursen er tilgængelig.
6. Medmindre tilsynsmyndigheden kræver andet, beregnes omregningen til indberetningsvalutaen ved at anvende valutakursen fra samme kilde som den, der anvendes i forsikrings- eller genforsikringsselskabets regnskaber i tilfælde af individuel indberetning, eller den samme kilde, som anvendes til koncernregnskabet i tilfælde af koncernrapportering.

Artikel 3

Genindberetning af oplysninger

Forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber er ansvarlige for kvaliteten af de indberettede oplysninger.

De genindberetter så hurtigt som praktisk muligt de indberettede oplysninger ved hjælp af de skemaer, der er omhandlet i denne gennemførelsesforordning, hvis:

- a) de oprindeligt indberettede oplysninger har ændret sig væsentligt i forhold til den samme indberetningsperiode efter indberetningen af disse oplysninger til tilsynsmyndighederne eller den koncerntilsynsførende, eller
- b) tilsynsmyndighederne eller den koncerntilsynsførende anmoder herom på grund af væsentlige datakvalitetsproblemer.

Artikel 4

Risikobaserede indberetningstærskler

1. Forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber pålægges ikke af tilsynsmyndighederne årligt at indsende de oplysninger, der er omhandlet i artikel 35 i direktiv 2009/138/EF, for hvilke der gælder en risikobaseret indberetningstærskel, når denne tærskel ikke overskrides i både det indeværende og det foregående indberetningsår.
2. Forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, som ikke overskrider den gældende risikobaserede indberetningstærskel, jf. ovenstående stykke, fritages for indberetning af de oplysninger, der er omhandlet i artikel 35 i direktiv 2009/138/EF, for hvilke der er anført risikobaserede indberetningstærskler i nærværende gennemførelsesforordning for det indeværende og det efterfølgende indberetningsår.
3. Forsikrings- og genforsikringsselskaber, captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, som ikke overskrider den gældende risikobaserede indberetningstærskel, jf. stk. 1, indberetter de oplysninger, der er omhandlet i artikel 35 i direktiv 2009/138/EF, for hvilke der er anført risikobaserede indberetningstærskler i nærværende gennemførelsesforordning for det indeværende indberetningsår, og foretager en revurdering af, hvorvidt tærsklerne overskrides i det efterfølgende indberetningsår.
4. Captive-forsikringsselskaber, der opfylder alle følgende betingelser, anvender skemaerne i denne forordnings artikel 7, 9, 11, 13, 14, 16, 18, 20, 22, 24 og 25:
 - a) i forbindelse med forsikringsforpligtelserne er alle forsikrede og begunstigede juridiske enheder i den koncern, som captive-forsikringsselskabet tilhører, eller som er fysiske personer, der kan omfattes af koncernforsikringspolicerne, så længe den virksomhed, der dækker fysiske personer, forbliver under 5 % af de forsikringsmæssige hensættelser
 - b) de forsikringsforpligtelser og de forsikringsaftaler, der ligger til grund for genforsikringsforpligtelserne, vedrører ikke en obligatorisk ansvarsforsikring for tredjemand.
5. Captive-genforsikringsselskaber, der opfylder alle følgende betingelser, anvender skemaerne i denne forordnings artikel 7, 9, 12, 15, 17, 19, 21, 22 og 25:
 - a) betingelserne i litra a) og b) i foregående stykke
 - b) lån til moderselskabet eller ethvert koncernselskab, herunder koncernkassebeholdning, overstiger ikke 20 % af captive-genforsikringsselskabets samlede aktiver
 - c) det maksimale tab som følge af de forsikringsmæssige bruttohensættelser kan vurderes deterministisk uden anvendelse af stokastiske metoder.

KAPITEL II

KVANTITATIVE INDBERETNINGSSKEMAER FOR INDIVIDUELLE SELSKABER

Artikel 5

Kvartalsvise kvantitative skemaer for individuelle selskaber

1. Medmindre indberetningens omfang eller hyppighed er begrænset i henhold til artikel 35, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF, indberetter forsikrings- og genforsikringsselskaber kvartalsvis de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.01.01.02 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag II til nærværende forordning
- b) skema S.01.02.01 i bilag I, om grundlæggende oplysninger om selskabet og indberetningens indhold generelt, efter vejledningen i afsnit S.01.02 i bilag II
- c) skema S.02.01.02 i bilag I, om balancen, under anvendelse af værdiansættelsesmetoden i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II til nærværende forordning
- d) skema S.05.01.02 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i selskabets regnskaber for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag II til nærværende forordning
- e) skema S.06.02.01 i bilag I, med en post-for-post-liste over aktiver, efter vejledningen i afsnit 06.02 i bilag II og under anvendelse af den supplerende identifikationskode (CIC-kode) som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- f) hvis andelen af kollektive investeringer, der besiddes af selskabet, overstiger 30 % af de samlede investeringer, skema S.06.03.01 i bilag I, om alle kollektive investeringer, der besiddes af selskabet, opgjort efter se-igennem-metoden, efter vejledningen i afsnit S.06.03 i bilag II
- g) skema S.08.01.01 i bilag I, med en post-for-post-liste over åbne derivatpositioner, efter vejledningen i afsnit S.08.01 i bilag II og under anvendelse af CIC-koden som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- h) skema S.12.01.02 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og sygeforsikring, der udøves på et forsikringsmæssigt grundlag svarende til livsforsikring (»SLT-sygeforsikring«), for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.12.01 i bilag II til nærværende forordning
- i) skema S.17.01.02 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.17.01 i bilag II
- j) skema S.23.01.01 i bilag I, om kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag II
- k) hvis forsikrings- og genforsikringsselskaberne udøver forsikrings- eller genforsikringsvirksomhed udelukkende inden for livsforsikring eller inden for skadesforsikring, skema S.28.01.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.01 i bilag II
- l) hvis forsikringsselskaberne udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.28.02.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.02 i bilag II.

2. Med henblik på stk. 1, litra f), bestemmer forsikrings- og genforsikringsselskaber andelen af kollektive investeringer, der besiddes af selskabet, af de samlede investeringer ved at anvende summen af post C0010/R0180, kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0220 og kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0090 i skema S.02.01.02 divideret med summen af post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.02.

Artikel 6

Kvartalsvise kvantitative skemaer for captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber

Medmindre indberetningens omfang eller hyppighed er begrænset i henhold til artikel 35, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF, indberetter captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber kvartalsvis de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.01.01.02 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag II
- b) skema S.01.02.01 i bilag I, om grundlæggende oplysninger om selskabet og indberetningens indhold generelt, efter vejledningen i afsnit S.01.02 i bilag II
- c) skema S.02.01.02 i bilag I, om balancen, under anvendelse af værdiansættelsesmetoden i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II til nærværende forordning
- d) skema S.05.01.02 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i selskabets regnskaber for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag II til nærværende forordning
- e) skema S.12.01.02 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og sygeforsikring, der udøves på et forsikringsmæssigt grundlag svarende til livsforsikring (»SLT-sygeforsikring«), for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.12.01 i bilag II til nærværende forordning
- f) skema S.17.01.02 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.17.01 i bilag II til nærværende forordning
- g) skema S.23.01.01 i bilag I, om kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag II
- h) hvis captive-forsikringselskaberne og captive-genforsikringselskaberne udøver forsikrings- eller genforsikringsvirksomhed udelukkende inden for livsforsikring eller inden for skadesforsikring, skema S.28.01.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.01 i bilag II
- i) hvis captive-forsikringselskaberne udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.28.02.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.02 i bilag II.

Artikel 7

Tilladte forenklinger for kvartalsvis indberetning for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber

1. Hvad angår de i artikel 5, stk. 1, litra c), og artikel 6, litra c), omhandlede oplysninger kan værdiansættelse af data i højere grad bygge på skøn og skønsmetoder end målinger af økonomiske data i årsregnskabet. Værdiansættelsen til brug for den kvartalsvise indberetning udformes således, at det sikres, at de deraf følgende oplysninger er troværdige og overholder standarderne i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, og at alle væsentlige oplysninger, der er relevante for forståelsen af dataene, indberettes i overensstemmelse med artikel 305 i delegeret forordning (EU) 2015/35.
2. Når forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber indberetter de i artikel 5, stk. 1, litra h) og i), og i artikel 6, litra e) og f), omhandlede oplysninger, kan de anvende forenkledte metoder ved beregningen af de forsikringsmæssige hensættelser.

Artikel 8

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber — Grundlæggende oplysninger og indberetningens indhold

Forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.01.01.01 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag II
- b) skema S.01.02.01 i bilag I, med grundlæggende oplysninger om selskabet og indberetningens indhold generelt, efter vejledningen i afsnit S.01.02 i bilag II
- c) skema S.01.03.01 i bilag I, med grundlæggende oplysninger om ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer, efter vejledningen i afsnit S.01.03 i bilag II.

Artikel 9

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber — Balancen og andre generelle oplysninger

Forsikrings- og genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.02.01.01 i bilag I, om balancen, under anvendelse af værdiansættelsesmetoden i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF og værdiansættelsen efter selskabets regnskaber, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II
- b) medmindre en enkelt valuta udgør mere end 80 % af de samlede passiver, skema S.02.02.01 i bilag I, om forpligtelser efter valuta, efter vejledningen i afsnit S.02.02 i bilag II
- c) skema S.03.01.01 i bilag I, om generelle oplysninger om ikkebalanceførte poster, efter vejledningen i afsnit S.03.01 i bilag II, hvis i) eller ii) finder anvendelse:
 - i) beløbet for én af følgende værdier overstiger 2 % af de samlede aktiver:
 - 1) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0010) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0300) plus maksimal værdi — Samlede eventualforpligtelser (C0010/R0400) eller
 - 2) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0030) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0200)
 - ii) selskabet har stillet eller modtaget en ubegrænset garanti
- d) skema S.04.02.01 i bilag I, om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF, undtagen fragtførerens ansvar, efter vejledningen i afsnit S.04.02 i bilag II
- e) skema S.04.03.01 i bilag I, om grundlæggende oplysninger — liste over enheder, der yder tegningsgaranti, efter vejledningen i afsnit S.04.03 i bilag II
- f) skema S.04.04.01 i bilag I, om aktivitet efter land — forsikringssted, efter vejledningen i afsnit S.04.04 i bilag II
- g) skema S.04.05.01 i bilag I, om aktivitet efter land — risikoplacering, efter vejledningen i afsnit S.04.05 i bilag II
- h) skema S.05.01.01 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i selskabets regnskaber, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag II.

*Artikel 10***Årlige kvantitative skemaer for captive-forsikringselskaber — Balancen og andre generelle oplysninger**

Captive-forsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.02.01.01 i bilag I, om balancen, under anvendelse af værdiansættelsesmetoden i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF og værdiansættelsen efter selskabets regnskaber, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II
- b) skema S.03.01.01 i bilag I, om generelle oplysninger om ikkebalanceførte poster, efter vejledningen i afsnit S.03.01 i bilag II, hvis i) og ii) finder anvendelse:
 - i) beløbet for én af følgende værdier overstiger 2 % af de samlede aktiver:
 - 1) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0010) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0300) plus maksimal værdi — Samlede eventualforpligtelser (C0010/R0400) eller
 - 2) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0030) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0200)
 - ii) selskabet har stillet eller modtaget en ubegrænset garanti
- c) skema S.04.02.01 i bilag I, om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF, undtagen fragtførerens ansvar, efter vejledningen i afsnit S.04.02 i bilag II
- d) skema S.04.03.01 i bilag I, om grundlæggende oplysninger — liste over enheder, der yder tegningsgaranti, efter vejledningen i afsnit S.04.03 i bilag II
- e) skema S.04.04.01 i bilag I, om aktivitet efter land — forsikringssted, efter vejledningen i afsnit S.04.04 i bilag II
- f) skema S.04.05.01 i bilag I, om aktivitet efter land — risikoplacering, efter vejledningen i afsnit S.04.05 i bilag II
- g) skema S.05.01.01 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i selskabets regnskaber, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag II.

*Artikel 11***Årlige kvantitative skemaer for captive-genforsikringselskaber — Balancen og andre generelle oplysninger**

Captive-genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.02.01.01 i bilag I, om balancen, under anvendelse af værdiansættelsesmetoden i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF og værdiansættelsen efter selskabets regnskaber, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II

- b) skema S.04.02.01 i bilag I, om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF, undtagen fragtførerens ansvar, efter vejledningen i afsnit S.04.02 i bilag II
- c) skema S.04.03.01 i bilag I, om grundlæggende oplysninger — liste over enheder, der yder tegningsgaranti, efter vejledningen i afsnit S.04.03 i bilag II til forordningen
- d) skema S.04.04.01 i bilag I, om aktivitet efter land — forsikringssted, efter vejledningen i afsnit S.04.04 i bilag II
- e) skema S.04.05.01 i bilag I, om aktivitet efter land — risikoplacering, efter vejledningen i afsnit S.04.05 i bilag II
- f) skema S.05.01.01 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i selskabets regnskaber, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag II.

Artikel 12

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber — Oplysninger om investeringer

Forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber indberetter årligt, medmindre de er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 7, i direktiv 2009/138/EF i forbindelse med et bestemt skema, de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis selskabet er fritaget for at indberette skema S.06.02.01 for det seneste kvartal i henhold til artikel 35, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF, skema S.06.02.01 i bilag I til nærværende forordning, med en post-for-post-liste over aktiver, efter vejledningen i afsnit S.06.02 i bilag II til nærværende forordning og under anvendelse af CIC-koden som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- b) hvis selskabet er fritaget for at indberette skema S.06.03.01 for det seneste kvartal i henhold til artikel 35, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF eller ikke har indberettet det kvartalsvis, fordi andelen af kollektive investeringer, der besiddes af selskabet, af de samlede investeringer, som omhandlet i nærværende forordnings artikel 5, stk. 1, litra f), ikke overstiger 30 %, skema S.06.03.01 i bilag I til nærværende forordning, om alle de kollektive investeringer, der besiddes af selskaberne, opgjort efter se-igennem-metoden, efter vejledningen i afsnit S.06.03 i bilag II
- c) skema S.06.04.01 i bilag I, om risici ved investeringer i relation til klimaændringer, efter vejledningen i afsnit S.06.04 i bilag II
- d) hvis værdien af strukturerede produkter, beregnet som summen af aktiver, der er klassificeret i kategori 5 og 6, som defineret i bilag V, udgør mere end 5 % af de samlede investeringer indberettet under post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.01, skema S.07.01.01 i bilag I, med en post-for-post-liste over strukturerede produkter, efter vejledningen i afsnit S.07.01 i bilag II
- e) hvis selskabet er fritaget for at indberette skema S.08.01.01 for det seneste kvartal i henhold til artikel 35, stk. 6, i direktiv 2009/138/EF, skema S.08.01.01 i bilag I til nærværende forordning, med en post-for-post-liste over åbne derivatpositioner, efter vejledningen i afsnit S.08.01 i bilag II til nærværende forordning og under anvendelse af CIC-koden som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- f) skema S.09.01.01 i bilag I, om indtægter, gevinster og tab i indberetningsperioden efter aktivkategori som defineret i bilag IV, efter vejledningen i afsnit S.09.01 i bilag II

- g) hvis værdien af de balanceførte og ikkebalanceførte underliggende værdipapirer i udlåns- eller genkøbsaftaler for så vidt angår kontrakter med en forfaldsdato efter referencedatoen for indberetningen udgør mere end 5 % af de samlede investeringer indberettet under post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.01, skema S.10.01.01 i bilag I, med en post-for-post-liste over aftaler om værdipapirudlån og -genkøb, balanceførte og ikkebalanceførte, efter vejledningen i afsnit S.10.01 i bilag II
- h) hvis andelen af værdien af aktiver, der besiddes som sikkerhed, i forhold til balancen, som indberettet under post C0010/R0500 i skema S.02.01.01 overstiger 10 %, skema S.11.01.01 i bilag I, med en post-for-post-liste over aktiver, der besiddes som sikkerhed, og hvor alle typer ikkebalanceførte aktivkategorier, der besiddes som sikkerhed, er medregnet, efter vejledningen i afsnit S.11.01 i bilag II.

Artikel 13

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringsselskaber — Forsikringsmæssige hensættelser og oplysninger om risici

1. Forsikrings- og genforsikringsselskaber og captive-forsikringsselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.12.01.01 i bilag I, om oplysninger opdelt efter branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35 for så vidt angår forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring, efter vejledningen i afsnit S.12.01 i bilag II
- b) skema S.12.02.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring efter land, hvor de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring vedrørende hjemlandet ikke udgør 100 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og det bedste bruttoskøn, efter vejledningen i afsnit S.12.02 i bilag II
- c) medmindre selskabet anvender forenklinger til beregning af de forsikringsmæssige hensættelser, for hvilke der ikke beregnes et skøn over de forventede fremtidige cash flows fra kontrakterne, skema S.13.01.01 i bilag I, med oplysninger om fremskrivning af det bedste skøn over fremtidige cash flows i livsforsikringsvirksomhed, jf. vejledningen i afsnit S.13.01 i bilag II
- d) skema S.14.01.01 i bilag I, om analyser af livsforsikringsforpligtelser, herunder livsforsikringsaftaler og annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler, efter produkt udstedt af selskabet, efter vejledningen i afsnit S.14.01 i bilag II
- e) skema S.14.02.01 i bilag I, om analyser af skadesforsikringsforpligtelser, efter brancher og kategorier af særlige produkter, udstedt af selskabet, efter vejledningen i afsnit S.14.02 i bilag II
- f) skema S.14.03 i bilag I, om forsikring mod cyberrisici, efter vejledningen i afsnit S.14.03 i bilag II, hvis en af følgende betingelser finder anvendelse:
- i) summen af præmier for enkeltstående cyberpolicer og policer med cyberdækning som en tillæggsdækning, hvor kun de anslåede præmieindtægter for cyberrisici skal tages i betragtning, er større end 5 % af selskabets samlede skadesforsikringsvirksomhed eller over 5 mio. EUR
 - ii) antallet af policer, der omfatter cyberrisikodækning, udgør mere end 3 % af det samlede antal policer inden for skadesforsikringsvirksomhed

- g) skema S.16.01.01 i bilag I, om annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser udstedt af selskabet i forbindelse med annuiteter hidrørende fra direkte forsikringsvirksomhed, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35
- h) skema S.17.01.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring efter branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.17.01 i bilag II
- i) skema S.17.03.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring for så vidt angår direkte forsikringsvirksomhed efter land, hvor de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring vedrørende hjemlandet ikke udgør 100 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og det bedste bruttoskøn, efter vejledningen i afsnit S.17.03 i bilag II
- j) medmindre selskabet anvender forenklinger til beregning af de forsikringsmæssige hensættelser, for hvilke der ikke beregnes et skøn over de forventede fremtidige cash flow fra kontrakterne, skema S.18.01.01 i bilag I, om frem skrivning af det bedste skøn over fremtidige cash flow i skadesforsikringsvirksomhed, for de brancher, der repræsenterer en dækning på 90 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og det bedste bruttoskøn, efter vejledningen i afsnit S.18.01 i bilag II
- k) skema S.19.01.01 i bilag I, om skadesforsikringskrav i form af udviklingstrekanter, i alt for hver skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35
- l) skema S.20.01.01 i bilag I, om udviklingen i fordelingen af erstatningsudgifter ved regnskabsårets udgang, for væsentlige brancher, der repræsenterer en dækning på 90 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.20.01 i bilag II
- m) skema S.21.01.01 i bilag I, om risikoprofilen for fordelingen af tab vedrørende skadesforsikringsvirksomhed for væsentlige brancher, der repræsenterer en dækning på 90 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.21.01 i bilag II
- n) skema S.21.02.01 i bilag I, om skadesforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.21.02 i bilag II
- o) skema S.21.03.01 i bilag I, om skadesforsikringsrisici efter forsikringssum efter væsentlige brancher, der repræsenterer en dækning på 90 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.21.03 i bilag II.

2. Med henblik på stk. 1, litra g), indberettes der for forsikrings- og genforsikringsselskaber, ud over captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, også oplysninger efter valuta, efter vejledningen i afsnit S.16.01. i bilag II. Oplysningerne efter valuta skal kun indberettes, hvis det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav på diskonteret grundlag fra en skadesforsikringsbranche udgør mere end 3 % af det samlede bedste skøn over alle hensættelser til annuitetskrav, med følgende opdeling:

- i) beløb for indberetningsvalutaen
- ii) beløb for alle valutaer, der udgør mere end 25 % af det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav på diskonteret grundlag i den oprindelige valuta fra den pågældende skadesforsikringsbranche
- iii) beløb for alle valutaer, der udgør mindre end 25 % af det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav (diskonteret grundlag) i den oprindelige valuta fra den pågældende skadesforsikringsbranche, men mere end 5 % af det samlede bedste skøn over alle hensættelser til annuitetskrav.

3. Med henblik på stk. 1, litra k), indberettes der for forsikrings- og genforsikringsselskaber, ud over captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber, også oplysninger efter valuta, efter vejledningen i afsnit S.19.01 i bilag II til nærværende forordning. Oplysningerne efter valuta skal kun indberettes, hvis det samlede bedste bruttoskøn for en skadesforsikringsbranche udgør mere end 10 % af det samlede bedste bruttoskøn over erstatningshensættelserne, med følgende opdeling:

- i) beløb for alle valutaer, der udgør mere end 25 % af det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelserne i den oprindelige valuta fra den pågældende skadesforsikringsbranche
- ii) beløb for alle valutaer, der udgør mindre end 25 % af det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelserne i den oprindelige valuta fra den pågældende skadesforsikringsbranche, men mere end 5 % af det samlede bedste bruttoskøn over alle erstatningshensættelser i den oprindelige valuta.

Artikel 14

Årlige kvantitative skemaer for captive-genforsikringsselskaber — Oplysninger om forsikringsmæssige hensættelser

Captive-genforsikringsselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.12.01.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og SLT-sygeforsikring efter branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.12.01 i bilag II
- b) skema S.19.01.21 i bilag I, om skadesforsikringskrav i form af udviklingstrekanter, i alt for hver skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.

Artikel 15

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringsselskaber — Oplysninger om langsigtede garantier

Forsikrings- og genforsikringsselskaber og captive-forsikringsselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.22.01.01 i bilag I, om virkningen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger, efter vejledningen i afsnit S.22.01 i bilag II
- b) skema S.22.04.01 i bilag I, om overgangsforanstaltninger for så vidt angår rentesatsen, efter vejledningen i afsnit S.22.04 i bilag II
- c) skema S.22.05.01 i bilag I, om overgangsforanstaltninger for så vidt angår forsikringsmæssige hensættelser, efter vejledningen i afsnit S.22.05 i bilag II
- d) skema S.22.06.01 i bilag I, om det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering efter land og valuta, efter vejledningen i afsnit S.22.06 i bilag II.

Artikel 16

Årlige kvantitative skemaer for captive-genforsikringsselskaber — Oplysninger om langsigtede garantier

Captive-genforsikringsselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af skema S.22.01.01 i bilag I, med oplysninger om virkningen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger, efter vejledningen i afsnit S.22.01 i bilag II.

*Artikel 17***Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber — Oplysninger om kapitalgrundlag og kapitalinteresser**

Forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.23.01.01 i bilag I, om kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag II
- b) skema S.23.02.01 i bilag I, med detaljerede oplysninger om kapitalgrundlaget opdelt efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital (tidligere benævnt tier 1, tier 2 og tier 3), efter vejledningen i afsnit S.23.02 i bilag II
- c) hvis kapitalgrundlaget for kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital ændrer sig mere end 5 % i forhold til det foregående år, skema S.23.03.01 i bilag I, om årlige bevægelser i kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.03 i bilag II
- d) hvis kapitalgrundlaget for kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital ændrer sig mere end 5 % i forhold til det foregående år, skema S.23.04.01 i bilag I, med en liste over elementer i kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.04 i bilag II
- e) skema S.24.01.01 i bilag I, om kapitalinteresser, der besiddes af selskabet, og et overblik over beregningen af fradraget i kapitalgrundlaget i forbindelse med kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, efter vejledningen i afsnit S.24.01 i bilag II.

*Artikel 18***Årlige kvantitative skemaer for captive-genforsikringselskaber — Oplysninger om kapitalgrundlag og kapitalinteresser**

Captive-genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af skema S.23.01.01 i bilag I, med angivelse af oplysninger om kapitalgrundlag, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag II.

*Artikel 19***Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber — Oplysninger om solvenskapitalkrav**

1. Forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis selskabet anvender standardformlen til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.01.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.01 i bilag II
- b) hvis selskabet anvender en partiel intern model eller en komplet intern model til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.05.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.05 i bilag II
- c) skema S.26.01.01 i bilag I, om markedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.01 i bilag II
- d) skema S.26.02.01 i bilag I, om modpartsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.02 i bilag II

- e) skema S.26.03.01 i bilag I, om livsforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.03 i bilag II
- f) skema S.26.04.01 i bilag I, om sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.04 i bilag II
- g) skema S.26.05.01 i bilag I, om skadesforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.05 i bilag II
- h) skema S.26.06.01 i bilag I, om operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.06 i bilag II
- i) skema S.26.07.01 i bilag I, om forenklinger anvendt ved beregningen af solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.26.07 i bilag II
- j) skema S.26.08.01 i bilag I, om yderligere oplysninger om den interne model for solvenskapitalkravet for selskaber, der anvender en partiel intern model eller en komplet intern model, efter vejledningen i afsnit S.26.08 i bilag II
- k) skema S.26.09.01 i bilag I, om en intern model for markeds- og kreditrisiko i forbindelse med finansielle instrumenter, efter vejledningen i afsnit S.26.09 i bilag II
- l) skema S.26.10.01 i bilag I, om oplysninger om porteføljen i den interne model ved kreditbegivenhedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.10 i bilag II
- m) skema S.26.11.01 i bilag I, om detaljerede oplysninger i forbindelse med den interne model for finansielle instrumenter ved kreditrisiko, efter vejledningen i afsnit S.26.11 i bilag II
- n) skema S.26.12.01 i bilag I, om en intern model for detaljerede oplysninger om ikkefinansielle instrumenter ved kreditrisiko, efter vejledningen i afsnit S.26.12 i bilag II
- o) skema S.26.13.01 i bilag I, om en intern model for skades- og NSLT-sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.13 i bilag II
- p) skema S.26.14.01 i bilag I, om en intern model for livs- og sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.14 i bilag II
- q) skema S.26.15.01 i bilag I, om en intern model for operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.15 i bilag II
- r) skema S.26.16.01 i bilag I, om ændringer i den interne model, efter vejledningen i afsnit S.26.16 i bilag II
- s) skema SR.27.01. om skadesforsikringskatastroferisici, efter vejledningen i afsnit S.27.01 i bilag II, som følger:
 - i) for forsikrings- og genforsikringsselskaber, bortset fra captive-forsikringsselskaber eller captive-genforsikringsselskaber, skema S. 27.01.01 i bilag I
 - ii) for captive-forsikringsselskaber eller captive-genforsikringsselskaber, kortfattede oplysninger og oplysninger om forenklinger, der er anvendt i forbindelse med katastroferisici ved skades- og sygeforsikring.

2. Ved ring-fenced fonde eller matchtilpasningsporteføljer indgives de i stk. 1, litra c)-s), omhandlede skemaer ikke for enheden som helhed.

3. Hvis der anvendes en partiel intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra c)-s), kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af standardformlen, og de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra j)-r), indberettes kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af den interne model.

4. Hvis der anvendes en komplet intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra c) -s), ikke, og de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra j) -r), indberettes.

Artikel 20

Årlige kvantitative skemaer for captive-genforsikringselskaber — Oplysninger om solvenskapitalkrav

1. Captive-genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis selskabet anvender standardformlen til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.01.21 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.01 i bilag II
- b) hvis selskabet anvender en partiel intern model eller en komplet intern model til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.05.21 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.05 i bilag II.

Artikel 21

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber — Oplysninger om minimumssolvenskapitalkrav

Forsikrings- og genforsikringselskaber og captive-forsikringselskaber og captive-genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis forsikrings- og genforsikringselskaberne udøver forsikrings- eller genforsikringsvirksomhed udelukkende inden for livsforsikring eller inden for skadesforsikring, skema S.28.01.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.01 i bilag II
- b) hvis forsikringselskaberne udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.28.02.01 i bilag I, om minimumskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.28.02 i bilag II.

Artikel 22

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber — Oplysninger om variationsanalyse

Forsikrings- og genforsikringselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.29.01.01 i bilag I, om variationen i overskydende aktiver i forhold til passiver, i løbet af indberetningsåret, med en oversigt over de vigtigste kilder til denne variation, efter vejledningen i afsnit S.29.01 i bilag II
- b) skema S.29.02.01 i bilag I, om den del af variationen i overskydende aktiver i forhold til passiver, i løbet af indberetningsåret, der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser, efter vejledningen i afsnit S.29.02 i bilag II
- c) skema S.29.03.01 og S.29.04.01 i bilag I, om den del af variationen i overskydende aktiver i forhold til passiver, i løbet af indberetningsåret, der skyldes forsikringsmæssige hensættelser, efter vejledningen i afsnit S.29.03 og 29.04 i bilag II.

Artikel 23

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringsselskaber — Oplysninger om genforsikring og special purpose vehicles (SPV'er)

Forsikrings- og genforsikringsselskaber og captive-forsikringsselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det samlede bedste skøn, der er beregnet separat for livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.30.01.01 i bilag I, med oplysninger om fakultativ dækning i det næste indberetningsår med oplysninger om de 20 største fakultative genforsikringsekspone-ringer og de to største inden for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for så vidt som de ikke er omfattet af de 20 største, for hvilke der anvendes fakultativ genforsikring, efter vejledningen i afsnit S.30.01 i bilag II til nærværende forordning
- b) hvis beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det samlede bedste skøn, der er beregnet separat for livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.30.02.01 i bilag I, med oplysninger om genforsikringsselskabernes andel af fakultative dækningsområder i det næste indberetningsår med oplysninger om de 20 største fakultative genforsikringsekspone-ringer og de to største inden for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for så vidt som de ikke er omfattet af de 20 største, efter vejledningen i afsnit S.30.02 i bilag II til nærværende forordning
- c) hvis beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det samlede bedste skøn, der er beregnet separat for livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.30.03.01 i bilag I, om det cederede genfor-sikringsprogram i næste indberetningsår, med prospektive oplysninger om genforsikringsaftaler, hvis gyldigheds-periode omfatter eller overlapper det følgende indberetningsår, efter vejledningen i afsnit S.30.03 i bilag II
- d) hvis beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det samlede bedste skøn, der er beregnet separat for livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skema S.30.04.01 i bilag I, om det cederede genfor-sikringsprogram i næste indberetningsår, med prospektive oplysninger om genforsikringsaftaler, hvis gyldigheds-periode omfatter eller overlapper det følgende indberetningsår, efter vejledningen i afsnit S.30.04 i bilag II
- e) skema S.31.01.01 i bilag I, om genforsikringsandelen, efter vejledningen i afsnit S.31.01 i bilag II
- f) skema S.31.02.01 i bilag I, om SPV'er set fra det forsikrings- eller genforsikringsselskabs synspunkt, der overfører risici til SPV'erne, efter vejledningen i afsnit S.31.02 i bilag II.

Artikel 24

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber og captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber — Oplysninger om ring-fenced fonde, væsentlige matchtilpasningsporteføljer og den resterende del

1. Forsikrings- og genforsikringsselskaber og captive-forsikringsselskaber og captive-genforsikringsselskaber indbe- retter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende hver væsentlig ring-fenced fond, hver væsentlig matchtilpasningsportefølje og den resterende del, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema SR.01.01.01 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag II
- b) for hver væsentlig ring-fenced fond og for den resterende del, skema SR.02.01.01 i bilag I, om balancen, under anvendelse af både værdiansættelsesreglerne i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF og værdiansættelsen efter selskabets regnskaber, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag II til nærværende forordning

- c) skema SR.12.01.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og SLT-sygeforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.12.01 i bilag II til nærværende forordning
- d) skema SR.17.01.01 i bilag I, om forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.17.01 i bilag II til nærværende forordning
- e) skema SR.22.02.01 i bilag I, om fremskrivningen af fremtidige cash flow til beregningen af det bedste skøn efter hver væsentlig matchtilpasningsportefølje, efter vejledningen i afsnit S.22.02 i bilag II
- f) SR.22.03.01 i bilag I, om matchtilpasningsporteføljerne efter hver væsentlig matchtilpasningsportefølje, efter vejledningen i afsnit S.22.03 i bilag II
- g) hvis selskabet anvender standardformlen til at beregne solvenskapitalkravet, skema SR.25.01.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.01 i bilag II
- h) hvis selskabet anvender en partiel intern model eller en komplet intern model til at beregne solvenskapitalkravet, skema SR.25.05.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.05 i bilag II
- i) skema SR.26.01.01 i bilag I, om markedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.01 i bilag II
- j) skema SR.26.02.01 i bilag I, om modpartsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.02 i bilag II
- k) skema SR.26.03.01 i bilag I, om livsforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.03 i bilag II
- l) skema SR.26.04.01 i bilag I, om sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.04 i bilag II
- m) skema SR.26.05.01 i bilag I, om skadesforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.05 i bilag II
- n) skema SR.26.06.01 i bilag I, om operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.06 i bilag II
- o) skema SR.26.07.01 i bilag I, om forenklinger anvendt ved beregningen af solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.26.07 i bilag II
- p) for selskaber, der anvender en partiel intern model eller en komplet intern model, skema S.26.08.01 i bilag I, om yderligere oplysninger om den interne model, der er anvendt for solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.26.08 i bilag II
- q) skema SR.27.01.01 i bilag I, om skadesforsikringskatastroferisici, efter vejledningen i afsnit S.27.01 i bilag II.

2. Hvis der anvendes en partiel intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra i) til o) og q), kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af standardformlen, og oplysningerne i det skema, der er omhandlet i stk. 1, litra p), indberettes i forbindelse med de risici, der er omfattet af den interne model.

3. Hvis der anvendes en komplet intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra i) til o) og q), ikke, og oplysningerne i det skema, der er omhandlet i stk. 1, litra p), indberettes.

Artikel 25

Årlige kvantitative skemaer for individuelle selskaber — Oplysninger om koncerninterne transaktioner

Forsikrings- og genforsikringsselskaber, der ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) eller c), i direktiv 2009/138/EF, og hvis moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i nævnte direktivs artikel 245, stk. 2, andet afsnit, sammenholdt med samme direktivs artikel 265, ved hjælp af følgende skemaer, og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.36.01.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner, der omfatter transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel, efter vejledningen i afsnit S.36.01 i bilag II
- b) skema S.36.02.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner i derivater, herunder de garantier, der understøtter derivater, efter vejledningen i afsnit S.36.02 i bilag II
- c) skema S.36.03.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner vedrørende ikkebalanceførte poster og eventualforpligtelser, efter vejledningen i afsnit S.36.03 i bilag II
- d) skema S.36.04.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner i forsikring og genforsikring, efter vejledningen i afsnit S.36.04 i bilag II
- e) skema S.36.05.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner vedrørende driftsresultatet, efter vejledningen i afsnit S.36.05 i bilag II.

Artikel 26

Kvantitative skemaer for individuelle selskaber — Oplysninger om koncerninterne transaktioner

Forsikrings- og genforsikringsselskaber, der ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) eller c), i direktiv 2009/138/EF, og hvis moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, skal indberette meget væsentlige koncerninterne transaktioner, jf. artikel 245, stk. 2, andet afsnit, i nævnte direktiv, og koncerninterne transaktioner, der skal indberettes under alle omstændigheder, jf. nævnte direktivs artikel 245, stk. 3, så hurtigt som muligt, ved hjælp af de relevante skemaer blandt skema S.36.00.01-S.36.05.01 i bilag I til nærværende forordning, efter vejledningen i afsnit S.36.00-S.36.05 i bilag II til nærværende forordning.

KAPITEL III

KVANTITATIVE INDBERETNINGSSKEMAER FOR KONCERNER

Artikel 27

Kvartalsvise kvantitative skemaer for koncerner

1. Medmindre indberetningens omfang eller hyppighed er begrænset i henhold til artikel 254, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, indberetter deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber kvartalsvis de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.01.01.05 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag III
- b) skema S.01.02.04 i bilag I, med grundlæggende oplysninger om koncernen og indberetningens indhold generelt, efter vejledningen i afsnit S.01.02 i bilag III

- c) hvis koncernen med henblik på at beregne koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2 som fastsat ved artikel 233 i det pågældende direktiv, skema S.02.01.02 i bilag I til denne forordning, om balanceoplysninger, under anvendelse af metoden til værdiansættelse i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag III til denne forordning
- d) skema S.05.01.02 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i koncernregnskabet, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag III til nærværende forordning
- e) skema S.06.02.04 i bilag I, med en post-for-post-liste over aktiver, efter vejledningen i afsnit 06.02 i bilag III og under anvendelse af CIC-koden som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- f) hvis andelen af kollektive investeringer, der besiddes af koncernen, overstiger 30 % af de samlede investeringer, skema S.06.03.04 i bilag I, om alle kollektive investeringer, der besiddes af koncernen, opgjort efter se-gennemmetoden, efter vejledningen i afsnit S.06.03 i bilag III
- g) skema S.08.01.04 i bilag I, med en post-for-post-liste over åbne derivatpositioner, efter vejledningen i afsnit S.08.01 i bilag III og under anvendelse af CIC-koden som angivet i bilag V og defineret i bilag VI
- h) skema S.23.01.04 i bilag I, om kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag III.

2. Med henblik på stk. 1, litra f), og hvis metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, bestemmes andelen af kollektive investeringer, der besiddes af koncernen, af de samlede investeringer af summen af post C0010/R0180, kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0220 og kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0090 i skema S.02.01.02 divideret med summen af post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.02. Hvis metode 1 anvendes sammen med metode 2, som fastsat i artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, beregnes andelen i henhold til første punktum i dette stykke og justeres for at afspejle de krævede poster hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.04.

Artikel 28

Tilladte forenklinger i kvartalsvis indberetning for koncerner

Hvad angår de i artikel 27, stk. 1, litra c), i nærværende forordning omhandlede oplysninger kan kvartalsvise målinger i højere grad bygge på skøn og estimeringsmetoder end målinger af økonomiske data i årsregnskabet. Målingsprocedurerne for den kvartalsvise indberetning udformes således, at de sikrer, at de deraf følgende oplysninger er troværdige og overholder standarderne i direktiv 2009/138/EF, og at alle væsentlige oplysninger, der er relevante for forståelsen af dataene, indberettes.

Artikel 29

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Grundlæggende oplysninger og indberetningens indhold

Deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.01.01.04 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag III

- b) skema S.01.02.04 i bilag I, med grundlæggende oplysninger om selskabet og indberetningens indhold generelt, efter vejledningen i afsnit S.01.02 i bilag III
- c) hvis koncernen med henblik på at beregne koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2 som fastsat ved nævnte direktivs artikel 233, skema S.01.03.04 i bilag I til nærværende forordning, med grundlæggende oplysninger om ring-fenced fonde og match-tilpasningsporteføljerne, efter vejledningen i afsnit S.01.03 i bilag III til nærværende forordning.

Artikel 30

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Balancen og andre generelle oplysninger

1. Deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.02.01.01 i bilag I, om balancen, under anvendelse af både værdiansættelsesreglerne i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF og værdiansættelsen efter koncernregnskaberne, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag III
- b) medmindre en enkelt valuta udgør mere end 80 % af de samlede passiver, skema S.02.02.01 i bilag I, om aktiver og passiver efter valuta, efter vejledningen i afsnit S.02.02 i bilag III
- c) skema S.03.01.04 i bilag I, om generelle oplysninger om ikkebalanceførte poster, efter vejledningen i afsnit S.03.01 i bilag III, hvis i) og ii) finder anvendelse:
- i) beløbet for én af følgende værdier overstiger 2 % af de samlede aktiver:
- 1) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0010) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0300) plus maksimal værdi — Samlede eventualforpligtelser (C0010/R0400) eller
 - 2) værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser (C0020/R0030) plus værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed (C0020/R0200)
- ii) selskabet har givet eller modtaget en ubegrænset garanti.
- d) skema S.05.01.01 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i koncernregnskabet, efter vejledningen i afsnit S.05.01 i bilag III til nærværende forordning
- e) skema S.05.02.01 i bilag I, om præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter land, under anvendelse af de værdiansættelses- og indregningsprincipper, der er anvendt i koncernregnskaberne, efter vejledningen i afsnit S.05.02 i bilag III.

2. De i stk. 1, litra a) og b), omhandlede skemaer indgives kun af deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der med henblik på beregningen af koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2 som fastsat ved nævnte direktivs artikel 233.

Artikel 31

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om investeringer

1. Medmindre de er fritaget i henhold til artikel 254, stk. 2, tredje afsnit, i direktiv 2009/138/EF i forbindelse med et bestemt skema, indberetter deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis koncernen er fritaget for at indberette skema S.06.02.04 for det seneste kvartal i henhold til artikel 254, stk. 2, andet afsnit, i direktiv 2009/138/EF, skema S.06.02.04 i bilag I til nærværende forordning, med en post-for-post-liste over aktiver, efter vejledningen i afsnit S.06.02 i bilag III til nærværende forordning
- b) hvis koncernen er fritaget fra at indberette skema S.06.03.04 for det seneste kvartal i henhold til artikel 254, stk. 2, andet afsnit, i direktiv 2009/138/EF eller ikke har indberettet det kvartalsvis, fordi andelen af kollektive investeringer, der besiddes af selskabet, af de samlede investeringer, som omhandlet i nærværende forordnings artikel 27, stk. 1, litra f), ikke overstiger 30 %, skema S.06.03.04 i bilag I til nærværende forordning, om alle de kollektive investeringer, der besiddes af selskaberne, opgjort efter se-igennem-metoden, efter vejledningen i afsnit S.06.03 i bilag III til nærværende forordning
- c) hvis andelen af strukturerede produkter, der besiddes af koncernen, overstiger 5 % af de samlede investeringer, skema S.07.01.04 i bilag I, med en post-for-post-liste over strukturerede produkter, efter vejledningen i afsnit S.07.01 i bilag III
- d) hvis koncernen er fritaget for at indberette skema S.08.01.04 for det seneste kvartal i henhold til artikel 254, stk. 2, andet afsnit, i direktiv 2009/138/EF, skema S.08.01.04 i bilag I til nærværende forordning, med en post-for-post-liste over åbne derivatpositioner, efter vejledningen i afsnit S.08.01 i bilag III til nærværende forordning
- e) skema S.09.01.04 i bilag I, om indtægter, gevinster og tab i indberetningsperioden efter aktivkategori som defineret i bilag IV, efter vejledningen i afsnit S.09.01 i bilag III
- f) hvis andelen af værdien af de balanceførte og ikkebalanceførte underliggende værdipapirer i udlåns- eller genkøbsaftaler for så vidt angår kontrakter med en forfaldsdato efter referencedatoen for indberetningen overstiger 5 % af de samlede investeringer, skema S.10.01.04 i bilag I, med en post-for-post-liste over aftaler om værdipapirudlån og -genkøb, balanceførte og ikkebalanceførte, efter vejledningen i afsnit S.10.01 i bilag III
- g) hvis andelen af værdien af aktiver, der besiddes som sikkerhed, i forhold til balancen, som indberettet under post C0010/R0500 i skema S.02.01.01 overstiger 10 %, skema S.11.01.04 i bilag I, med en post-for-post-liste over aktiver, der besiddes som sikkerhed, og hvor alle typer ikkebalanceførte aktivkategorier, der besiddes som sikkerhed, er medregnet, efter vejledningen i afsnit S.11.01 i bilag III.

2. Med henblik på stk. 1, litra c), og hvis metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, bestemmes andelen af værdien af strukturerede produkter, der besiddes af koncernen, af de samlede investeringer af summen af aktiver klassificeret i aktivkategori 5 og 6, som defineret i bilag IV til nærværende forordning, divideret med summen af post C0010/R0070 og C0010/R0020 i skema S.02.01.01. Hvis metode 1 anvendes sammen med metode 2, som fastsat i artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, beregnes andelen i henhold til første punktum i dette stykke og justeres for at afspejle de krævede poster hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.04.

3. Med henblik på stk. 1, litra f), og hvis metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, bestemmes andelen af summen af de balanceførte og ikkebalanceførte underliggende værdipapirer i udlåns- eller genkøbsaftaler, for så vidt angår kontrakter med en forfaldsdato efter referencedatoen for indberetningen, divideret med summen af post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.01. Hvis metode 1 anvendes sammen med metode 2, som fastsat i artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene med henblik på beregning af koncernsolvensen, beregnes andelen i henhold til første punktum i dette stykke og justeres for at afspejle de krævede poster hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.04.

Artikel 32

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om langsigtede garantier

Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af skema S.22.01.04 i bilag I til nærværende forordning, med oplysninger om virkningen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger, efter vejledningen i afsnit S.22.01 i bilag III til nærværende forordning.

Artikel 33

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om kapitalgrundlag

1. Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema S.23.01.04 i bilag I, om kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.01 i bilag III.
- b) skema S.23.02.04 i bilag I, med detaljerede oplysninger om kapitalgrundlaget efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital, efter vejledningen i afsnit S.23.02 i bilag III
- c) hvis kapitalgrundlaget for kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital ændrer sig mere end 5 % i forhold til det foregående år, skema S.23.03.04 i bilag I, om årlige bevægelser i kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.03 i bilag III
- d) hvis kapitalgrundlaget for kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital ændrer sig mere end 5 % i forhold til det foregående år, skema S.23.04.04 i bilag I, med en liste over elementer i kapitalgrundlaget, efter vejledningen i afsnit S.23.04 i bilag III.

Med henblik på litra d) indberettes skemaet ved tilstedeværelse af ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer, uanset tærsklen.

2. De i stk. 1, litra b) og c), omhandlede skemaer indgives kun af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der med henblik på beregningen af koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2 som fastsat ved nævnte direktivs artikel 233.

Artikel 34

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om solvenskapitalkrav

1. Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der med henblik på beregning af koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2, jf. samme direktivs artikel 233, indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, ved hjælp af følgende skemaer, og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) hvis koncernen anvender standardformlen til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.01.04 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.01 i bilag III
- b) hvis koncernen anvender en partiel intern model eller en komplet intern model til at beregne solvenskapitalkravet, skema S.25.05.04 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.05 i bilag III
- c) skema S.26.01.04 i bilag I, om markedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.01 i bilag III
- d) skema S.26.02.04 i bilag I, om modpartsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.02 i bilag III
- e) skema S.26.03.04 i bilag I, om livsforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.03 i bilag III
- f) skema S.26.04.04 i bilag I, om sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.04 i bilag III
- g) skema S.26.05.04 i bilag I, om skadesforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.05 i bilag III
- h) skema S.26.06.04 i bilag I, om operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.06 i bilag III
- i) skema S.26.07.04 i bilag I, om forenklinger anvendt ved beregningen af solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.26.07 i bilag III
- j) skema S.26.08.04 i bilag I, om yderligere oplysninger om den interne model for solvenskapitalkravet for selskaber, der anvender en partiel intern model eller en komplet intern model, efter vejledningen i afsnit S.26.08 i bilag III
- k) skema S.26.09.04 i bilag I, om en intern model for markeds- og kreditrisiko i forbindelse med finansielle instrumenter, efter vejledningen i afsnit S.26.09 i bilag III
- l) skema S.26.10.01 i bilag I, om oplysninger om porteføljen i den interne model ved kreditbegivenhedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.10 i bilag III
- m) skema S.26.11.01 i bilag I, om en intern model for detaljerede oplysninger om kreditrisiko ved finansielle instrumenter, efter vejledningen i afsnit S.26.11 i bilag III
- n) skema S.26.12.01 i bilag I, om en intern model for detaljerede oplysninger om kreditrisiko ved ikkefinansielle instrumenter, efter vejledningen i afsnit S.26.12 i bilag III
- o) skema S.26.13.01 i bilag I, om en intern model for skades- og NSLT-sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.13 i bilag III
- p) skema S.26.14.01 i bilag I, om en intern model for livs- og sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.14 i bilag III
- q) skema S.26.15.01 i bilag I, om oplysninger vedrørende en intern model for operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.15 i bilag III

r) skema S.26.16.01 i bilag I, om ændringer i den interne model, efter vejledningen i afsnit S.26.16 i bilag III

s) skema S.27.01.04 i bilag I, om skadesforsikringskatastroferisici, efter vejledningen i afsnit S.27.01 i bilag III.

2. Ved ring-fenced fonde eller matchtilpasningsporteføljer indgives de i stk. 1, litra c) til i) og s), og litra j) til r), omhandlede skemaer ikke for koncernen som helhed.

3. Hvis der anvendes en partiel intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra c) til i) og s), kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af standardformlen, og oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra j) til r), indberettes kun for de risici, der er omfattet af den interne model.

4. Hvis der anvendes en komplet intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra c) til i) og s), ikke, og oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra j) til r), indberettes.

Artikel 35

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om genforsikringsselskaber og special purpose vehicles (SPV'er)

Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

a) skema S.31.01.04 i bilag I, om genforsikringsandelen, efter vejledningen i afsnit S.31.01 i bilag III

b) skema S.31.02.04 i bilag I, om SPV'er set fra det forsikrings- eller genforsikringsselskabs synspunkt, der overfører risici til SPV'erne, efter vejledningen i afsnit S.31.02 i bilag III.

Artikel 36

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Koncernspecifikke oplysninger

Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

a) skema S.32.01.04 i bilag I, om de forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen, efter vejledningen i afsnit S.32.01 i bilag III

b) skema S.33.01.04 i bilag I, om krav gældende for forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen, efter vejledningen i afsnit S.33.01 i bilag III

c) skema S.34.01.04 i bilag I, om andre finansielle selskaber end forsikrings- og genforsikringsselskaber, og om ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, jf. definitionen i artikel 1, nr. 52, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter vejledningen i afsnit S.34.01 i bilag III

d) skema S.35.01.04 i bilag I, om de forsikringsmæssige hensættelser hos selskaberne i koncernen, efter vejledningen i afsnit S.35.01 i bilag III

- e) skema S.36.01.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner, der omfatter transaktioner af egenkapital-typen, gælds- og aktivoverførsel, over den tærskel, der er fastsat af den koncerntilsynsførende i henhold til artikel 245, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.36.01 i bilag III til nærværende forordning
- f) skema S.36.02.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner i derivater, herunder de garantier, der understøtter derivater, over den tærskel, der er fastsat af den koncerntilsynsførende i henhold til artikel 245, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.36.02 i bilag III til nærværende forordning
- g) skema S.36.03.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner vedrørende ikkebalanceførte poster og eventualforpligtelser, over den tærskel, der er fastsat af den koncerntilsynsførende i henhold til artikel 245, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.36.03 i bilag III til nærværende forordning
- h) skema S.36.04.01 i bilag I, om væsentlige koncerninterne transaktioner vedrørende forsikring og genforsikring, over den tærskel, der er fastsat af den koncerntilsynsførende i henhold til artikel 245, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.36.04 i bilag III til nærværende forordning
- i) skema S.36.05.01 i bilag I, om koncerninterne transaktioner vedrørende driftsresultatet, efter vejledningen i afsnit S.36.05 i bilag III
- j) skema S.37.01.04 i bilag I, om væsentlige risikokoncentrationer, over den tærskel, der er fastsat af den koncerntilsynsførende i henhold til artikel 244, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, efter vejledningen i afsnit S.37.01 i bilag III til nærværende forordning.
- k) skema S.37.02.04 om eksponering for risikokoncentration efter valuta, sektor og land, efter vejledningen i afsnit S.37.02 i bilag III til denne forordning
- l) skema S.37.03.04 om eksponering for risikokoncentration efter aktivklasse og vurdering, efter vejledningen i afsnit S.37.03 i bilag III til denne forordning.

Artikel 37

Årlige kvantitative skemaer for koncerner — Oplysninger om ring-fenced fonde, væsentlige matchtilpasningsporteføljer og den resterende del

1. Deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der med henblik på beregning af koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2, jf. samme direktivs artikel 233, indberetter årligt de oplysninger, der er omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt med samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af følgende skemaer i forbindelse med alle væsentlige ring-fenced fonde og alle væsentlige matchtilpasningsporteføljer vedrørende den del, der er konsolideret som omhandlet i artikel 335, stk. 1, litra a) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, samt i forbindelse med den resterende del, og i overensstemmelse med følgende vejledninger:

- a) skema SR.01.01.04 i bilag I, om indberetningens indhold, efter vejledningen i afsnit S.01.01 i bilag III
- b) hvis koncernen anvender standardformlen til at beregne solvenskapitalkravet, skema SR.25.01.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.01 i bilag III
- c) hvis koncernen anvender en partiel intern model eller en komplet intern model til at beregne solvenskapitalkravet, skema SR.25.05.01 i bilag I, om solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.25.05 i bilag III

- d) skema SR.26.01.01 i bilag I, om markedsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.01 i bilag III
- e) skema SR.26.02.01 i bilag I, om modpartsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.02 i bilag III
- f) skema SR.26.03.01 i bilag I, om livsforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.03 i bilag III
- g) skema SR.26.04.01 i bilag I, om sygeforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.04 i bilag III
- h) skema SR.26.05.01 i bilag I, om skadesforsikringsrisici, efter vejledningen i afsnit S.26.05 i bilag III
- i) skema SR.26.06.01 i bilag I, om operationelle risici, efter vejledningen i afsnit S.26.06 i bilag III
- j) skema SR.26.07.01 i bilag I, om forenklinger anvendt ved beregningen af solvenskapitalkravet, efter vejledningen i afsnit S.26.07 i bilag III
- k) skema SR.26.08.01 i bilag I, om yderligere oplysninger om den interne model for solvenskapitalkravet for selskaber, der anvender en partiel intern model eller en komplet intern model, efter vejledningen i afsnit S.26.08 i bilag III
- l) skema SR.27.01.01 i bilag I, om skadesforsikringskatastroferisici, efter vejledningen i afsnit S.27.01 i bilag III.

2. Hvis der anvendes en partiel intern model, indberettes oplysningerne i de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra d) til j) og l), kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af standardformlen, og det skema, der er omhandlet i stk. 1, litra k), indberettes kun i forbindelse med de risici, der er omfattet af den interne model.

3. Hvis der anvendes en komplet intern model, indberettes de skemaer, der er omhandlet i stk. 1, litra d) til j) og l), ikke, og det skema, der er omhandlet i stk. 1, litra k), indberettes.

4. Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der med henblik på beregning af koncernsolvensen anvender metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, enten alene eller sammen med metode 2, jf. samme direktivs artikel 233, indberetter årligt, ud over de oplysninger, der indberettes ved hjælp af de i stk. 1 omhandlede skemaer, oplysninger om balancen i forbindelse med alle væsentlige ring-fenced fonde relateret til den del, der er konsolideret, jf. artikel 335, stk. 1, litra a) eller c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, samt i forbindelse med den resterende del, som omhandlet i artikel 304, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35, sammenholdt samme delegerede forordnings artikel 372, stk. 1, ved hjælp af skema SR.02.01.01 i bilag I til nærværende forordning, efter vejledningen i afsnit S.02.01 i bilag III til nærværende forordning.

Artikel 38

Kvantitative skemaer for koncerner — Koncerninterne transaktioner og risikokoncentrationer

Deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber indberetter:

- a) væsentlige og meget væsentlige koncerninterne transaktioner som omhandlet i artikel 245, stk. 2, første og andet afsnit, i direktiv 2009/138/EF og koncerninterne transaktioner, der skal indberettes under alle omstændigheder, som omhandlet i nævnte direktivs artikel 245, stk. 3, ved hjælp af skema S.36.01.01, S.36.02.01, S.36.03.01, S.36.04.01 og S.36.05.01, alt efter hvilket der er relevant, i bilag I til nærværende forordning, efter vejledningen i afsnit S.36.01-S.36.05 i bilag III til nærværende forordning

- b) væsentlige risikokoncentrationer som omhandlet i artikel 244, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF og risikokoncentrationer, der skal indberettes under alle omstændigheder, som omhandlet i nævnte direktivs artikel 244, stk. 3, ved hjælp af skema S.37.01.04 i bilag I til nærværende forordning, efter vejledningen i afsnit S.37.01 i bilag III til nærværende forordning.

KAPITEL IV

AFSLUTTENDE BESTEMMELSER

Artikel 39

Ophævelse af gennemførelsesforordning (EU) 2015/2450

Gennemførelsesforordning (EU) 2015/2450 ophæves.

Artikel 40

Ikrafttræden og anvendelsesdato

Denne forordning træder i kraft dagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Den anvendes fra den 31. december 2023.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 4. april 2023.

På Kommissionens vegne
Ursula VON DER LEYEN
Formand

BILAG I

S.01.01.01**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------------|--|--------------|--------------|
| S.01.02.01 | Grundlæggende oplysninger — Generelt | R0010 | |
| S.01.03.01 | Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | R0020 | |
| S.02.01.01 | Balance | R0030 | |
| S.02.02.01 | Passiver efter valuta | R0040 | |
| S.03.01.01 | Ikkebalanceførte poster — generelt | R0060 | |
| S.04.02.01 | Oplysninger om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til Solvens II-direktivet, undtagen fragtførerens ansvar | R0100 | |
| S.04.03.01 | Grundlæggende oplysninger — liste over forsikringsudbydende enheder | R0104 | |
| S.04.04.01 | Aktivitet efter land — det sted, hvor forsikringen tegnes | R0105 | |
| S.04.05.01 | Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig | R0106 | |
| S.05.01.01 | Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | R0110 | |
| S.06.02.01 | Liste over aktiver | R0140 | |
| S.06.03.01 | Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode | R0150 | |
| S.06.04.01 | Risici som følge af klimaændringer i relation til investeringer | R0151 | |
| S.07.01.01 | Strukturerede produkter | R0160 | |
| S.08.01.01 | Åbne derivater | R0170 | |
| S.09.01.01 | Indtægter/gevinster og tab i perioden | R0190 | |
| S.10.01.01 | Værdipapirudlån og -genkøb | R0200 | |
| S.11.01.01 | Aktiver, der besiddes som sikkerhed | R0210 | |
| S.12.01.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring | R0220 | |
| S.12.02.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring — Efter land | R0230 | |
| S.13.01.01 | Fremskrivning af fremtidige cash flow, opgjort brutto | R0240 | |
| S.14.01.01 | Analyse af livsforsikringsforpligtelser | R0250 | |
| S.14.02.01 | Skadesforsikring — oplysninger om policer og kunder | R0251 | |
| S.14.03.01 | Cyberforsikringsrisiko | R0252 | |
| S.16.01.01 | Oplysninger om annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsvirksomhed | R0280 | |
| S.17.01.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring | R0290 | |

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------|--|--------------|-------|
| S.17.02.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring — Efter land | R0300 | |
| S.18.01.01 | Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Skadesforsikring) | R0310 | |
| S.19.01.01 | Skadesforsikringserstatninger | R0320 | |
| S.20.01.01 | Udvikling i fordelingen af erstatningsudgifter | R0330 | |
| S.21.01.01 | Risikoprofil for fordeling af tab | R0340 | |
| S.21.02.01 | Skadesforsikringsrisici | R0350 | |
| S.21.03.01 | Fordeling af skadesforsikringsrisici — Efter forsikringssum | R0360 | |
| S.22.01.01 | Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger | R0370 | |
| S.22.04.01 | Overgangsforanstaltninger for beregning af rentesatser | R0380 | |
| S.22.05.01 | Overordnet beregning af overgangsforanstaltningerne for forsikringsmæssige hensættelser | R0390 | |
| S.22.06.01 | Bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering efter land og valuta | R0400 | |
| S.23.01.01 | Kapitalgrundlag | R0410 | |
| S.23.02.01 | Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag, opdelt efter kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital (tiers) | R0420 | |
| S.23.03.01 | Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget | R0430 | |
| S.23.04.01 | Liste over kapitalgrundlagselementer | R0440 | |
| S.24.01.01 | Kapitalinteresser, der besiddes | R0450 | |
| S.25.01.01 | Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender standardformlen | R0460 | |
| S.25.05.01 | Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | R0470 | |
| S.26.01.01 | Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | R0500 | |
| S.26.02.01 | Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | R0510 | |
| S.26.03.01 | Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | R0520 | |
| S.26.04.01 | Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | R0530 | |
| S.26.05.01 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | R0540 | |
| S.26.06.01 | Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | R0550 | |
| S.26.07.01 | Solvenskapitalkrav — Forenklinger | R0560 | |
| S.26.08.01 | Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | R0561 | |
| S.26.09.01 | Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder | R0562 | |
| S.26.10.01 | Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed — Porteføljeoversigt | R0563 | |
| S.26.11.01 | Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed for finansielle instrumenter | R0564 | |

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------|---|--------------|-------|
| S.26.12.01 | Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter | R0565 | |
| S.26.13.01 | Intern model — Skades- og sygeforsikring (Ikke-SLT)) | R0566 | |
| S.26.14.01 | Intern model — Livs- og sygeforsikring | R0567 | |
| S.26.15.01 | Intern model — Operationel risiko | R0568 | |
| S.26.16.01 | Intern model — Ændringer af modellen | R0569 | |
| S.27.01.01 | Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici | R0570 | |
| S.28.01.01 | Minimumskapitalkrav — Udelukkende livsforsikrings- eller livsgenforsikringsvirksomhed eller udelukkende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksomhed | R0580 | |
| S.28.02.01 | Minimumskapitalkrav — Både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed | R0590 | |
| S.29.01.01 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | R0600 | |
| S.29.02.01 | Overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser | R0610 | |
| S.29.03.01 | Overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes forsikringsmæssige hensættelser | R0620 | |
| S.29.04.01 | Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser | R0630 | |
| S.30.01.01 | Grundlæggende oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed | R0640 | |
| S.30.02.01 | Oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed | R0650 | |
| S.30.03.01 | Grundlæggende oplysninger om cederede genforsikringprogrammer | R0660 | |
| S.30.04.01 | Oplysninger om andele af cederede genforsikringprogrammer | R0670 | |
| S.31.01.01 | Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er) | R0680 | |
| S.31.02.01 | Special purpose vehicles (SPV'er) | R0690 | |
| S.36.01.01 | Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel | R0740 | |
| S.36.02.01 | Koncerninterne transaktioner — Derivater | R0750 | |
| S.36.03.01 | Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser | R0760 | |
| S.36.04.01 | Koncerninterne transaktioner —Forsikring og genforsikring | R0770 | |
| S.36.05.01 | Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab) | R0775 | |

S.01.01.02**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------------|--|--------------|--------------|
| S.01.02.01 | Grundlæggende oplysninger — Generelt | R0010 | |
| S.02.01.02 | Balance | R0030 | |
| S.05.01.02 | Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | R0110 | |
| S.06.02.01 | Liste over aktiver | R0140 | |
| S.06.03.01 | Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode | R0150 | |
| S.08.01.01 | Åbne derivater | R0170 | |
| S.12.01.02 | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring | R0220 | |
| S.17.01.02 | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring | R0290 | |
| S.23.01.01 | Kapitalgrundlag | R0410 | |
| S.28.01.01 | Minimumskapitalkrav — Udelukkende livsforsikrings- eller livs-genforsikringsvirksomhed eller udelukkende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksomhed | R0580 | |
| S.28.02.01 | Minimumskapitalkrav — Både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed | R0590 | |

S.01.01.04**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------------|--|--------------|--------------|
| S.01.02.04 | Grundlæggende oplysninger — Generelt | R0010 | |
| S.01.03.04 | Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | R0020 | |
| S.02.01.01 | Balance | R0030 | |
| S.02.02.01 | Passiver efter valuta | R0040 | |
| S.03.01.04 | Ikkebalanceførte poster — generelt | R0060 | |
| S.05.01.01 | Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | R0110 | |
| S.05.02.04 | Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter land | R0120 | |
| S.06.02.04 | Liste over aktiver | R0140 | |
| S.06.03.04 | Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode | R0150 | |
| S.06.04.01 | Risici som følge af klimaændringer i relation til investeringer | R0151 | |
| S.07.01.04 | Strukturerede produkter | R0160 | |
| S.08.01.04 | Åbne derivater | R0170 | |
| S.09.01.04 | Indtægter/gevinster og tab i perioden | R0190 | |
| S.10.01.04 | Værdipapirudlån og -genkøb | R0200 | |
| S.11.01.04 | Aktiver, der besiddes som sikkerhed | R0210 | |
| S.22.01.04 | Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger | R0370 | |
| S.23.01.04 | Kapitalgrundlag | R0410 | |
| S.23.02.04 | Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag, opdelt efter kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital (tiers) | R0420 | |
| S.23.03.04 | Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget | R0430 | |
| S.23.04.04 | Liste over kapitalgrundlagselementer | R0440 | |
| S.25.01.04 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender standardformlen | R0460 | |
| S.25.05.04 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | R0470 | |
| S.26.01.04 | Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | R0500 | |
| S.26.02.04 | Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | R0510 | |
| S.26.03.04 | Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | R0520 | |
| S.26.04.04 | Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | R0530 | |
| S.26.05.04 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | R0540 | |

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------|--|--------------|-------|
| S.26.06.04 | Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | R0550 | |
| S.26.07.04 | Solvenskapitalkrav — Forenklinger | R0560 | |
| S.26.08.04 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | R0561 | |
| S.26.09.04 | Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder | R0562 | |
| S.26.10.01 | Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed — Porteføljeoversigt | R0563 | |
| S.26.11.01 | Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed for finansielle instrumenter | R0564 | |
| S.26.12.01 | Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter | R0565 | |
| S.26.13.01 | Intern model — Skades- og sygeforsikring (Ikke-SLT)) | R0566 | |
| S.26.14.01 | Intern model — Livs- og sygeforsikring | R0567 | |
| S.26.15.01 | Intern model — Operationel risiko | R0568 | |
| S.26.16.01 | Intern model — Ændringer af modellen | R0569 | |
| S.27.01.04 | Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici | R0570 | |
| S.31.01.04 | Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er) | R0680 | |
| S.31.02.04 | Special purpose vehicles (SPV'er) | R0690 | |
| S.32.01.04 | Selskaber, der indgår i koncernen | R0700 | |
| S.33.01.04 | Individuelle krav for forsikrings- og genforsikringsselskaber | R0710 | |
| S.34.01.04 | Individuelle krav vedrørende andre regulerede finansielle selskaber og andre ikkeregulerede finansielle selskaber, herunder forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber | R0720 | |
| S.35.01.04 | Bidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser | R0730 | |
| S.36.01.01 | Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel | R0740 | |
| S.36.02.01 | Koncerninterne transaktioner — Derivater | R0750 | |
| S.36.03.01 | Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser | R0760 | |
| S.36.04.01 | Koncerninterne transaktioner —Forsikring og genforsikring | R0770 | |
| S.36.05.01 | Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab) | R0775 | |
| S.37.01.04 | Risikokoncentration | R0780 | |
| S.37.02.04 | Risikokoncentration — Eksponering efter valuta, sektor, land | R0785 | |
| S.37.03.04 | Risikokoncentration — Eksponering efter aktivklasse og vurdering | R0786 | |

S.01.01.05**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | C0010 |
|------------------|--|--------------|--------------|
| S.01.02.04 | Grundlæggende oplysninger — Generelt | R0010 | |
| S.02.01.02 | Balance | R0030 | |
| S.05.01.02 | Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | R0110 | |
| S.06.02.04 | Liste over aktiver | R0140 | |
| S.06.03.04 | Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode | R0150 | |
| S.08.01.04 | Åbne derivater | R0170 | |
| S.23.01.04 | Kapitalgrundlag | R0410 | |

SR.01.01.01**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | | |
|------------------|---|--|--------------|--------------|
| | | Ring-fenced fond/matchningsportefølje/resterende del | Z0010 | |
| | | Fonds-/porteføljenummer | Z0020 | |
| | | | | C0010 |
| SR.02.01.01 | Balance | | R0790 | |
| SR.12.01.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring | | R0800 | |
| SR.17.01.01 | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring | | R0810 | |
| SR.22.02.01 | Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Matchningsporteføljer) | | R0820 | |
| SR.22.03.01 | Oplysninger om beregning af matchtilpasning | | R0830 | |
| SR.25.01.01 | Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender standardformlen | | R0840 | |
| SR.25.05.01 | Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | | R0850 | |
| SR.26.01.01 | Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | | R0870 | |
| SR.26.02.01 | Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | | R0880 | |
| SR.26.03.01 | Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | | R0890 | |
| SR.26.04.01 | Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | | R0900 | |
| SR.26.05.01 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | | R0910 | |
| SR.26.06.01 | Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | | R0920 | |
| SR.26.07.01 | Solvenskapitalkrav — Forenklinger | | R0930 | |
| SR.26.08.01 | Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender interne modeller | | R0935 | |
| SR.27.01.01 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringskatastroferisici | | R0940 | |

SR.01.01.04**Indberetningens indhold**

| Skemakode | Skemanavn | | | |
|------------------|---|--|--------------|--------------|
| | | Ring-fenced fond/matchningsportefølje/resterende del | Z0010 | |
| | | Fonds-/porteføljenummer | Z0020 | |
| | | | | C0010 |
| SR.02.01.04 | Balance | | R0790 | |
| SR.25.01.01 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender standardformlen | | R0840 | |
| SR.25.05.01 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | | R0850 | |
| SR.26.01.01 | Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | | R0870 | |
| SR.26.02.01 | Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | | R0880 | |
| SR.26.03.01 | Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | | R0890 | |
| SR.26.04.01 | Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | | R0900 | |
| SR.26.05.01 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | | R0910 | |
| SR.26.06.01 | Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | | R0920 | |
| SR.26.07.01 | Solvenskapitalkrav — Forenklinger | | R0930 | |
| SR.26.08.04 | Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender interne modeller | | R0935 | |
| SR.27.01.01 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringskatastroferisici | | R0940 | |

S.01.02.01**Grundlæggende oplysninger — Generelt**

| | | C0010 |
|--|--------------|--------------|
| Selskabets navn | R0010 | |
| Selskabets identifikationskode | R0020 | |
| Type selskab | R0040 | |
| Land, hvor tilladelse er meddelt | R0050 | |
| Indberetningsprog | R0070 | |
| Indberetningsdato | R0080 | |
| Regnskabsårets udgang | R0081 | |
| Referencedato for indberetning | R0090 | |
| Regelmæssig indberetning/ad hoc-indberetning | R0100 | |
| Indberetningsvaluta | R0110 | |
| Regnskabsstandarder | R0120 | |
| Beregningsmetode for solvenskapitalkravet | R0130 | |
| Anvendelse af selskabsspecifikke parametre | R0140 | |
| Ring fenced fonde | R0150 | |
| Matchtilpasning | R0170 | |
| Volatilitetsjustering | R0180 | |
| Overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter | R0190 | |
| Overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | R0200 | |
| Første indberetning eller genindberetning | R0210 | |
| Fritagelse fra indberetning af ECAI-oplysninger | R0250 | |
| Direkte URL-link til det websted, hvor rapporten om solvens og finansiell situation er offentliggjort | R0255 | |
| Direkte URL-link til download af rapporten om solvens og finansiell situation (SFCR) svarende til dette regnskabsårs indberetningsforpligtelse (R0090) | R0260 | |
| Captive-virksomhed | R0270 | |
| Afviklingsvirksomhed (Run-Off Business) | R0280 | |
| Fusioner og overtagelser i perioden | R0290 | |

S.01.02.04**Grundlæggende oplysninger — Generelt**

| | | C0010 |
|---|--------------|--------------|
| Navn på deltagende selskab | R0010 | |
| Koncernidentifikationskode | R0020 | |
| Sammenslutningens navn | R0025 | |
| Koncerntilsynsførendes land | R0050 | |
| Oplysninger om koncerndel | R0060 | |
| Indberetningsprog | R0070 | |
| Indberetningsdato | R0080 | |
| Regnskabsårets udgang | R0081 | |
| Referencedato for indberetning | R0090 | |
| Regelmæssig indberetning/ad hoc-indberetning | R0100 | |
| Indberetningsvaluta | R0110 | |
| Regnskabsstandarder | R0120 | |
| Beregningsmetode for koncernens solvenskapitalkrav (SCR) | R0130 | |
| Anvendelse af koncernspecifikke parametre | R0140 | |
| Ring fenced fonde | R0150 | |
| Beregningsmetode for koncernsolvens | R0160 | |
| Matchtilpasning | R0170 | |
| Volatilitetsjustering | R0180 | |
| Overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter | R0190 | |
| Overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | R0200 | |
| Første indberetning eller genindberetning | R0210 | |
| Fritagelse fra indberetning af ECAI-oplysninger | R0250 | |
| Direkte URL-link til det websted, hvor rapporten om solvens og finansiell situation er offentliggjort | R0255 | |
| Direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation | R0260 | |
| Captive-virksomhed | R0270 | |
| Afviklingsvirksomhed (Run-Off Business) | R0280 | |
| Fusioner og overtagelser i perioden | R0290 | |

S.01.03.01**Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer**

Liste over alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer (overlapping tilladt)

| Fonds-/porteføljenummer | Navn på ring-fenced fond/ matchtilpasningsportefølje | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del af en fond | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Materiale | Artikel 304 |
|-------------------------|---|---|---|-----------|-------------|
| C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| | | | | | |

Liste over ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer

| Antal ring-fenced fonde/ matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Antal afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer |
|---|--|--|
| C0100 | C0110 | C0120 |
| | | |

S.01.03.04**Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer**

Liste over alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer (overlapping tilladt)

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | Fonds-/porteføljenummer | Navn på ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del af en fond | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Materiale | Artikel 304 |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|---|---|---|-----------|-------------|
| C0010 | C0020 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| | | | | | | | |

Liste over ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer

| Antal ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Antal afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsportefølje |
|---|---|--|
| C0100 | C0110 | C0120 |
| | | |

S.02.01.01**Balance****Aktiver**

Goodwill

Udskudte anskaffelsesomkostninger

Immaterielle aktiver

Udskudte skatteaktiver

Pensionsmæssigt overskud

Materielle anlægsaktiver, som besiddes til eget brug

Investeringer (bortset fra aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler)

Ejendomme (bortset fra til eget brug)

Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser

Aktier

Aktier — noterede

Aktier — unoterede

Obligationer

Statsobligationer

Erhvervsobligationer

Strukturerede værdipapirer

Sikrede værdipapirer

Kollektive investeringsinstitutter

Derivater

Indskud, bortset fra likvider

Øvrige investeringer

Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler

Lån, herunder realkreditlån

Policelån

Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer

Andre lån, herunder realkreditlån

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--------------|------------------|-----------------------|
| | C0010 | C0020 |
| R0010 | | |
| R0020 | | |
| R0030 | | |
| R0040 | | |
| R0050 | | |
| R0060 | | |
| R0070 | | |
| R0080 | | |
| R0090 | | |
| R0100 | | |
| R0110 | | |
| R0120 | | |
| R0130 | | |
| R0140 | | |
| R0150 | | |
| R0160 | | |
| R0170 | | |
| R0180 | | |
| R0190 | | |
| R0200 | | |
| R0210 | | |
| R0220 | | |
| R0230 | | |
| R0240 | | |
| R0250 | | |
| R0260 | | |

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--|------------------|-----------------------|
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler fra: | R0270 | |
| Skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0280 | |
| Skadesforsikring undtagen sygeforsikring | R0290 | |
| Sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0300 | |
| Livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0310 | |
| Sygeforsikring svarende til livsforsikring | R0320 | |
| Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0330 | |
| Livsforsikring, indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0340 | |
| Indskud til cedenter | R0350 | |
| Tilgodehavender fra forsikringer og mæglere | R0360 | |
| Tilgodehavender fra genforsikring | R0370 | |
| Tilgodehavender (handel, ikke forsikring) | R0380 | |
| Egne aktier (som besiddes direkte) | R0390 | |
| Forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garantikapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0400 | |
| Likvider | R0410 | |
| Alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds | R0420 | |
| Aktiver i alt | R0500 | |
| Forpligtelser | | |
| | C0010 | C0020 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring | R0510 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | R0520 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0530 | |
| Det bedste skøn | R0540 | |
| Risikomargin | R0550 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | R0560 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0570 | |
| Det bedste skøn | R0580 | |
| Risikomargin | R0590 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | R0600 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | R0610 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0620 | |

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--|------------------|-----------------------|
| Det bedste skøn | R0630 | |
| Risikomargin | R0640 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) | R0650 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0660 | |
| Det bedste skøn | R0670 | |
| Risikomargin | R0680 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked | R0690 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0700 | |
| Det bedste skøn | R0710 | |
| Risikomargin | R0720 | |
| Andre forsikringsmæssige hensættelser | R0730 | |
| Eventualforpligtelser | R0740 | |
| Hensættelser, som ikke er forsikringsmæssige hensættelser | R0750 | |
| Pensionsforpligtelser | R0760 | |
| Indskud fra genforsikringsselskaber | R0770 | |
| Udskudte skatteforpligtelser | R0780 | |
| Derivater | R0790 | |
| Gæld til kreditinstitutter | R0800 | |
| Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter | R0810 | |
| Forpligtelser vedrørende forsikringer og mæglere | R0820 | |
| Forpligtelser vedrørende genforsikring | R0830 | |
| Forpligtelser (handel, ikke forsikring) | R0840 | |
| Efterstillet gæld | R0850 | |
| Efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0860 | |
| Efterstillet gæld medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0870 | |
| Alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds | R0880 | |
| Passiver i alt | R0900 | |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver | R1000 | |

S.02.01.02**Balance****Aktiver**

Goodwill

Udskudte anskaffelsesomkostninger

Immaterielle aktiver

Udskudte skatteaktiver

Pensionsmæssigt overskud

Materielle anlægsaktiver, som besiddes til eget brug

Investeringer (bortset fra aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler)

Ejendomme (bortset fra til eget brug)

Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser

Aktier

Aktier — noterede

Aktier — unoterede

Obligationer

Statsobligationer

Erhvervsobligationer

Strukturerede værdipapirer

Sikrede værdipapirer

Kollektive investeringsinstitutter

Derivater

Indskud, bortset fra likvider

Øvrige investeringer

Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler

Lån, herunder realkreditlån

| | Solvens II-værdi |
|-------|------------------|
| | C0010 |
| R0010 | |
| R0020 | |
| R0030 | |
| R0040 | |
| R0050 | |
| R0060 | |
| R0070 | |
| R0080 | |
| R0090 | |
| R0100 | |
| R0110 | |
| R0120 | |
| R0130 | |
| R0140 | |
| R0150 | |
| R0160 | |
| R0170 | |
| R0180 | |
| R0190 | |
| R0200 | |
| R0210 | |
| R0220 | |
| R0230 | |

| | | Solvens II-værdi |
|--|--------------|------------------|
| Policelån | R0240 | |
| Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer | R0250 | |
| Andre lån, herunder realkreditlån | R0260 | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler fra: | R0270 | |
| Skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0280 | |
| Skadesforsikring undtagen sygeforsikring | R0290 | |
| Sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0300 | |
| Livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0310 | |
| Sygeforsikring svarende til livsforsikring | R0320 | |
| Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0330 | |
| Livsforsikring, indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0340 | |
| Indskud til cedenter | R0350 | |
| Tilgodehavender fra forsikringer og mæglere | R0360 | |
| Tilgodehavender fra genforsikring | R0370 | |
| Tilgodehavender (handel, ikke forsikring) | R0380 | |
| Egne aktier (som besiddes direkte) | R0390 | |
| Forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garantikapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0400 | |
| Likvider | R0410 | |
| Alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds | R0420 | |
| Aktiver i alt | R0500 | |
| Forpligtelser | | C0010 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring | R0510 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | R0520 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0530 | |
| Det bedste skøn | R0540 | |

| | Solvens II-værdi |
|--|------------------|
| Risikomargin | R0550 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | R0560 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0570 |
| Det bedste skøn | R0580 |
| Risikomargin | R0590 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | R0600 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | R0610 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0620 |
| Det bedste skøn | R0630 |
| Risikomargin | R0640 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) | R0650 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0660 |
| Det bedste skøn | R0670 |
| Risikomargin | R0680 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked | R0690 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0700 |
| Det bedste skøn | R0710 |
| Risikomargin | R0720 |
| Andre forsikringsmæssige hensættelser | R0730 |
| Eventualforpligtelser | R0740 |
| Hensættelser, som ikke er forsikringsmæssige hensættelser | R0750 |
| Pensionsforpligtelser | R0760 |
| Indskud fra genforsikringsselskaber | R0770 |
| Udskudte skatteforpligtelser | R0780 |
| Derivater | R0790 |

| | Solvens II-værdi |
|--|------------------|
| Gæld til kreditinstitutter | R0800 |
| Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter | R0810 |
| Forpligtelser vedrørende forsikringer og mæglere | R0820 |
| Forpligtelser vedrørende genforsikring | R0830 |
| Forpligtelser (handel, ikke forsikring) | R0840 |
| Efterstillet gæld | R0850 |
| Efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0860 |
| Efterstillet gæld medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0870 |
| Alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds | R0880 |
| Passiver i alt | R0900 |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver | R1000 |

SR.02.01.01**Balance**

Ring-fenced fond eller resterende del

Z0020

Fondsnummer

Z0030**Aktiver**

Goodwill

R0010

Udskudte anskaffelsesomkostninger

R0020

Immaterielle aktiver

R0030

Udskudte skatteaktiver

R0040

Pensionsmæssigt overskud

R0050

Materielle anlægsaktiver, som besiddes til eget brug

R0060

Investeringer (bortset fra aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler)

R0070

Ejendomme (bortset fra til eget brug)

R0080

Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser

R0090

Aktier

R0100

Aktier — noterede

R0110

Aktier — unoterede

R0120

Obligationer

R0130

Statsobligationer

R0140

Erhvervsobligationer

R0150

Strukturerede værdipapirer

R0160

Sikrede værdipapirer

R0170

Kollektive investeringsinstitutter

R0180

Derivater

R0190

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--------------|------------------|-----------------------|
| | C0010 | C0020 |
| R0010 | | |
| R0020 | | |
| R0030 | | |
| R0040 | | |
| R0050 | | |
| R0060 | | |
| R0070 | | |
| R0080 | | |
| R0090 | | |
| R0100 | | |
| R0110 | | |
| R0120 | | |
| R0130 | | |
| R0140 | | |
| R0150 | | |
| R0160 | | |
| R0170 | | |
| R0180 | | |
| R0190 | | |

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--|------------------|-----------------------|
| Indskud, bortset fra likvider | R0200 | |
| Øvrige investeringer | R0210 | |
| Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0220 | |
| Lån, herunder realkreditlån | R0230 | |
| Policelån | R0240 | |
| Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer | R0250 | |
| Andre lån, herunder realkreditlån | R0260 | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler fra: | R0270 | |
| Skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0280 | |
| Skadesforsikring undtagen sygeforsikring | R0290 | |
| Sygeforsikring svarende til skadesforsikring | R0300 | |
| Livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0310 | |
| Sygeforsikring svarende til livsforsikring | R0320 | |
| Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0330 | |
| Livsforsikring, indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0340 | |
| Indskud til cedenter | R0350 | |
| Tilgodehavender fra forsikringer og mæglere | R0360 | |
| Tilgodehavender fra genforsikring | R0370 | |
| Tilgodehavender (handel, ikke forsikring) | R0380 | |
| Egne aktier (som besiddes direkte) | R0390 | |
| Forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garanti-kapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0400 | |
| Likvider | R0410 | |
| Alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds | R0420 | |
| Aktiver i alt | R0500 | |

| | | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--|--------------|------------------|-----------------------|
| | | C0010 | C0020 |
| Forpligtelser | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring | R0510 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | R0520 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0530 | | |
| Det bedste skøn | R0540 | | |
| Risikomargin | R0550 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | R0560 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0570 | | |
| Det bedste skøn | R0580 | | |
| Risikomargin | R0590 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | R0600 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | R0610 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0620 | | |
| Det bedste skøn | R0630 | | |
| Risikomargin | R0640 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) | R0650 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0660 | | |
| Det bedste skøn | R0670 | | |
| Risikomargin | R0680 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked | R0690 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0700 | | |
| Det bedste skøn | R0710 | | |
| Risikomargin | R0720 | | |
| Andre forsikringsmæssige hensættelser | | | |
| Eventualforpligtelser | R0740 | | |

| | Solvens II-værdi | Regnskabsmæssig værdi |
|--|------------------|-----------------------|
| Hensættelser, som ikke er forsikringsmæssige hensættelser | R0750 | |
| Pensionsforpligtelser | R0760 | |
| Indskud fra genforsikringsselskaber | R0770 | |
| Udskudte skatteforpligtelser | R0780 | |
| Derivater | R0790 | |
| Gæld til kreditinstitutter | R0800 | |
| Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter | R0810 | |
| Forpligtelser vedrørende forsikringer og mæglere | R0820 | |
| Forpligtelser vedrørende genforsikring | R0830 | |
| Forpligtelser (handel, ikke forsikring) | R0840 | |
| Efterstillet gæld | R0850 | |
| Efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0860 | |
| Efterstillet gæld medregnet i basiskapitalgrundlaget | R0870 | |
| Alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds | R0880 | |
| Passiver i alt | R0900 | |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver | R1000 | |

S.02.02.01

Passiver efter valuta

Valutakode

| | | |
|-------|------------------|-----|
| | Væsentlig valuta | |
| R0010 | | ... |

| | | |
|--------------------------------|--|--------------------------------------|
| Samlet værdi for alle valutaer | Værdi for Solvens II-indberetningsvalutaen | Værdi for resterende øvrige valutaer |
| C0020 | C0030 | C0040 |

| | |
|-------------------------------|-----|
| Værdi for væsentlige valutaer | |
| C0050 | ... |

Forpligtelser

Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler)

Forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler

Indskud fra genforsikringselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring

Derivater

Finansielle forpligtelser

Eventualforpligtelser

Alle øvrige passiver

Passiver i alt

| | | | |
|--------------|---|---|---|
| | X | X | X |
| R0110 | | | |
| R0120 | | | |
| R0130 | | | |
| R0140 | | | |
| R0150 | | | |
| R0160 | | | |
| R0170 | | | |
| R0200 | | | |

| | |
|---|-----|
| X | X |
| | ... |
| | ... |
| | ... |
| | ... |
| | ... |
| | ... |
| | ... |

S.03.01.01

Ikkebalanceførte poster — generelt

| | Maksimal værdi | Værdi af garanti/ sikkerhedsstillelse/ eventualforpligtel- ser | Værdi af aktiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Værdi af passiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Oplysninger om ubegrænsede garan- tier |
|---|----------------|---|---|--|--|
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Garantier stillet af selskabet, herunder remburs | | | | | |
| R0010 | | | | | |
| Heraf garantier, herunder remburs, stillet til andre selskaber i den samme koncern. | | | | | |
| R0020 | | | | | |
| Garantier modtaget af selskabet, herunder remburs | | | | | |
| R0030 | | | | | |
| Heraf garantier, herunder remburs, modtaget fra andre selskaber i den samme koncern. | | | | | |
| R0040 | | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes | | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes, for ydede lån eller købte obligationer. | | | | | |
| R0100 | | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes, for derivater | | | | | |
| R0110 | | | | | |
| Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringselskaber for afgivne forsikringsmæssige hensættelser | | | | | |
| R0120 | | | | | |
| Anden sikkerhed, der besiddes | | | | | |
| R0130 | | | | | |
| Sikkerhed i alt, der besiddes | | | | | |
| R0200 | | | | | |
| Stillet sikkerhed | | | | | |
| Sikkerhed, der er stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer. | | | | | |
| R0210 | | | | | |
| Sikkerhed, der er stillet, for derivater | | | | | |
| R0220 | | | | | |
| Aktiver, der er stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). | | | | | |
| R0230 | | | | | |

| | Maksimal værdi | Værdi af garanti/ sikkerhedsstillelse/ eventualforpligtel- ser | Værdi af aktiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Værdi af passiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Oplysninger om ubegrænsede garan- tier |
|---|----------------|---|---|--|--|
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Anden sikkerhed, der er stillet | R0240 | | | | |
| Sikkerhed i alt, der er stillet | R0300 | | | | |
| Eventualforpligtelser | | | | | |
| Eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen | R0310 | | | | |
| Of which contingent liabilities toward entities of the same group | R0320 | | | | |
| Eventualforpligtelser, der er opført på Solvens II-balancen | R0330 | | | | |
| Eventualforpligtelser i alt | R0400 | | | | |
| Ubegrænsede garantier | | | | | |
| modtaget | R0510 | | | | |
| stillet | R0520 | | | | |

S.03.01.04

Ikkebalanceførte poster — generelt

| | Maksimal værdi | Værdi af garanti/ sikkerhedsstillelse/ eventualforpligtel- ser | Værdi af aktiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Værdi af passiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Oplysninger om ubegrænsede garan- tier |
|---|----------------|---|---|--|--|
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Garantier stillet af koncernen, herunder remburs | R0010 | | | | |
| Garantier modtaget af koncernen, herunder remburs | R0030 | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes | | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes, for ydede lån eller købte obligationer. | R0100 | | | | |
| Sikkerhed, der besiddes, for derivater | R0110 | | | | |
| Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskaber for afgivne forsikringsmæssige hensættelser | R0120 | | | | |
| Anden sikkerhed, der besiddes | R0130 | | | | |
| Sikkerhed i alt, der besiddes | R0200 | | | | |
| Stillet sikkerhed | | | | | |
| Sikkerhed, der er stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer. | R0210 | | | | |
| Sikkerhed, der er stillet, for derivater | R0220 | | | | |
| Aktiver, der er stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). | R0230 | | | | |
| Anden sikkerhed, der er stillet | R0240 | | | | |
| Sikkerhed i alt, der er stillet | R0300 | | | | |
| Eventualforpligtelser | | | | | |

Eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen
 Heraf eventualforpligtelser over for enheder i den samme concern
 Eventualforpligtelser, der er opført på Solvens II-balancen
Eventualforpligtelser i alt
Ubegrænsede garantier
 modtaget
 stillet

| | Maksimal værdi | Værdi af garanti/ sikkerhedsstillelse/ eventualforpligtel- ser | Værdi af aktiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Værdi af passiver, for hvilke sikker- heden besiddes | Oplysninger om ubegrænsede garan- tier |
|--------------|----------------|---|---|--|--|
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0310 | | | | | |
| R0320 | | | | | |
| R0330 | | | | | |
| R0400 | | | | | |
| | | | | | |
| R0510 | | | | | |
| R0520 | | | | | |

S.04.02.01

Oplysninger om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til Solvens II-direktivet, undtagen fragtførerens ansvar

| | | |
|----------|--------------|-----|
| EØS-land | R0010 | ... |
|----------|--------------|-----|

| | | Virksomhed | Efter EØS-land | | ... | |
|--|--------------|----------------------------------|----------------|----------------------------------|--------|----------------------------------|
| | | Fri udveksling af tjenesteydelse | Filial | Fri udveksling af tjenesteydelse | Filial | Fri udveksling af tjenesteydelse |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | ... | |
| Hyppighed af krav vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | R0020 | | | | | |
| Gennemsnitlige erstatningsudgifter vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | R0030 | | | | | |

S.04.03.01

Grundlæggende oplysninger — liste over forsikringsudbydende enheder

Liste over forsikringsudbydende enheder

| Kode for den forsikringsudbydende enhed | Kode for type forsikringsudbydende enhed | Type enhed | Lokalisering af type filial | Etableringsland |
|---|--|--------------|-----------------------------|-----------------|
| C0010 | C0011 | C0020 | C0030 | C0040 |
| | | | | |

S.04.04.01

Aktivitet efter land — det sted, hvor forsikringen tegnes

| | |
|---------|-------|
| Branche | Z0010 |
|---------|-------|

| | |
|---|-------|
| Kode for den forsikringsudbydende enhed | Z0020 |
| EØS-land | R0010 |

| | | Efter forsikringsudbydende enhed | Efter forsikringsudbydende enhed og efter EØS-land (lokalisering af aktivitet [baseret på det sted, hvor forsikringsvirksomheden er indgået]) | ... | |
|--------------------------|-------|---|---|--|-----|
| | | Forsikringsvirksomhed indgået i etableringslandet | Forsikringsvirksomhed indgået via fri udveksling af tjenesteydelser i et andet land end etableringslandet | Forsikringsvirksomhed indgået i det berørte land via fri udveksling af tjenesteydelser | ... |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | |
| Tegnede præmier — Brutto | R0020 | | | | |
| Erstatningsudgifter | R0030 | | | | |
| Erhvervsomkostninger | R0040 | | | | |
| heraf provisioner | R0050 | | | | |

S.04.05.01

Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig

| | |
|---|-------|
| Branche | Z0010 |
| Kode for den forsikringsudbydende enhed | Z0020 |

| | |
|------|-------|
| Land | R0010 |
|------|-------|

| | | Samlet aktivitet for den forsikringsudbydende enhed | ... | Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig | ... |
|------------------------------|-------|---|-----|---|-----|
| | | Den samlede virksomhed indgået af selskaberne | ... | Samlet aktivitet efter land | ... |
| | | C0010 | | C0020 | |
| Tegnede præmier — Brutto | R0020 | | | | |
| Præmieindtægter — Brutto | R0030 | | | | |
| Erstatningsudgifter — Brutto | R0040 | | | | |
| Omkostninger — Brutto | R0050 | | | | |

S.05.01.01

Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | | | | | | |
|--|--------------|---|-----------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|
| | | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomstsikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvars-forsikring | Anden motor-forsikring | Sø-, luftfarts- og transport-forsikring | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0110 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0120 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0130 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0140 | | | | | | | | | |
| Netto | R0200 | | | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0210 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0220 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0230 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0240 | | | | | | | | | |
| Netto | R0300 | | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | | | | | | |
|--|--------------|--|-----------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomstsikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvars-forsikring | Anden motor-forsikring | Sø-, luftfarts- og transport-forsikring | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kauforsikring |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Erstatningsudgifter | | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0310 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0320 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0330 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0340 | | | | | | | | | |
| Netto | R0400 | | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | Branche vedrørende: Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | I alt | |
|-----------------------------|--------------|--|--------------|------------------------|--|-------------------|---|-------|--------------------|
| | | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab | Sygeforsikring | Ulykkesforsikring | Sø-, luftfarts- og transport-forsikring | | Ejendomsforsikring |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | | C0160 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0110 | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | Branche vedrørende: Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | I alt | |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|--|-------------------|--|-------|--------------------|
| | | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab | Sygeforsikring | Ulykkesforsikring | Sø-, luftfarts- og transportforsikring | | Ejendomsforsikring |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | | C0160 |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0120 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0130 | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0140 | | | | | | | | |
| Netto | R0200 | | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0210 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0220 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0230 | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0240 | | | | | | | | |
| Netto | R0300 | | | | | | | | |
| Erstatningsudgifter | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0310 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0320 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0330 | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0340 | | | | | | | | |
| Netto | R0400 | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikringsforpligtelser | | | Branche vedrørende: Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | I alt | |
|--|--------------|---|--------------|------------------------|--|-------------------|--|-------|--------------------|
| | | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab | Sygeforsikring | Ulykkesforsikring | Sø-, luftfarts- og transportforsikring | | Ejendomsforsikring |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | | C0160 |
| Omkostninger | R0550 | | | | | | | | |
| Administrationsomkostninger | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0610 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0620 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0630 | X | X | X | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0640 | | | | | | | | |
| Netto | R0700 | | | | | | | | |
| Udgifter til forvaltning af investeringer | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0710 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0720 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0730 | X | X | X | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0740 | | | | | | | | |
| Netto | R0800 | | | | | | | | |
| Udgifter til forvaltning af krav | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0810 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0820 | | | | X | X | X | X | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0830 | X | X | X | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0840 | | | | | | | | |
| Netto | R0900 | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Livsforsikringsforpligtelser | | | | | Livsgegensikringsforpligtelser | | I alt | |
|--|--------------|---|------------------------------|--|----------------------|--|---|----------------|------------------|--------------|
| | | Sygeforsikring | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unitlinked forsikring | Anden livsforsikring | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | Sygegensikring | Livsgegensikring | |
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0300 |
| Erhvervsomkostninger | | | | | | | | | | |
| Brutto | R2210 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R2220 | | | | | | | | | |
| Netto | R2300 | | | | | | | | | |
| Overheadomkostninger | | | | | | | | | | |
| Brutto | R2310 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R2320 | | | | | | | | | |
| Netto | R2400 | | | | | | | | | |
| Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | R2500 | | | | | | | | | |
| Samlede omkostninger | R2600 | | | | | | | | | |
| Genkøb i alt | R2700 | | | | | | | | | |

S.05.01.02

Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | | | | | | |
|--|--------------|---|-----------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|---|------------------------------|-------------------------------|
| | | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomstsikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvars-forsikring | Anden motor-forsikring | Sø-, luftfarts- og transport-forsikring | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0110 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0120 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0130 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0140 | | | | | | | | | |
| Netto | R0200 | | | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0210 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0220 | | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0230 | | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0240 | | | | | | | | | |
| Netto | R0300 | | | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | Branche vedrørende: Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | I alt |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|--|-------------------|--|--------------|
| | | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab | Sygeforsikring | Ulykkesforsikring | Sø-, luftfarts- og transportforsikring | |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0110 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0120 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0130 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0140 | | | | | | | |
| Netto | R0200 | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0210 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0220 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0230 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0240 | | | | | | | |
| Netto | R0300 | | | | | | | |
| Erstatningsudgifter | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0310 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0320 | | | | | | | |

| | | Branche vedrørende: Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser (direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring) | | | Branche vedrørende: Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | I alt | |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|--|-------------------|--|-------|--------------------|
| | | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab | Sygeforsikring | Ulykkesforsikring | Sø-, luftfarts- og transportforsikring | | Ejendomsforsikring |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | | C0160 |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0330 | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0340 | | | | | | | | |
| Netto | R0400 | | | | | | | | |
| Ændringer i andre forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0410 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0420 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0430 | | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0440 | | | | | | | | |
| Netto | R0500 | | | | | | | | |
| Omkostninger | R0550 | | | | | | | | |
| Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | R1200 | | | | | | | | |
| Samlede omkostninger | R1300 | | | | | | | | |

S.05.02.04

Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter land

| | | Hjemland | Top 5-lande (efter beløb for tegnede bruttopræmier) — Skadesforsikringsvirksomhed | | | | | Top 5 i alt og hjemland |
|--|--------------|----------|---|-------|-------|-------|-------|-------------------------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| R0010 | | X | | | | | | X |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0110 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0120 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0130 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0140 | | | | | | | |
| Netto | R0200 | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0210 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0220 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0230 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R0240 | | | | | | | |
| Netto | R0300 | | | | | | | |
| Erstatningsudgifter | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0310 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0320 | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0330 | | | | | | | |

| | | Hjemland | Top 5-lande (efter beløb for tegnede bruttopræmier) — Skadesforsikringsvirksomhed | | | | | Top 5 i alt og hjemland |
|--|--------------|----------|---|-------|-------|-------|-------|-------------------------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| | R0010 | | | | | | | |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| Genforsikringsandel | R0340 | | | | | | | |
| Netto | R0400 | | | | | | | |
| Omkostninger | R0550 | | | | | | | |
| Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | R1210 | | | | | | | |
| Samlede omkostninger | R1300 | | | | | | | |

| | | Hjemland | Top 5-lande (efter beløb for tegnede bruttopræmier) — livsforsikringsforpligtelser | | | | | Top 5 i alt og hjemland |
|------------------------|--------------|----------|--|-------|-------|-------|-------|-------------------------|
| | | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 |
| | R1400 | | | | | | | |
| | | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 |
| Tegnede præmier | | | | | | | | |
| Brutto | R1410 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R1420 | | | | | | | |
| Netto | R1500 | | | | | | | |
| Præmieindtægter | | | | | | | | |
| Brutto | R1510 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R1520 | | | | | | | |
| Netto | R1600 | | | | | | | |

| | | Hjemland | Top 5-lande (efter beløb for tegnede bruttopræmier) — livsforsikringsforpligtelser | | | | | Top 5 i alt og hjemland |
|--|-------|----------|--|-------|-------|-------|-------|-------------------------|
| | | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 |
| | R1400 | | | | | | | |
| | | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 |
| Erstatningsudgifter | | | | | | | | |
| Brutto | R1610 | | | | | | | |
| Genforsikringsandel | R1620 | | | | | | | |
| Netto | R1700 | | | | | | | |
| Omkostninger | R1900 | | | | | | | |
| Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | R2510 | | | | | | | |
| Samlede omkostninger | R2600 | | | | | | | |

S.06.02.01

Liste over aktiver

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Portefølje | Fondsnummer | Matchningsportefølje-nummer | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | Aktiv stillet som sikkerhed | Deponeeringsland | Depotinstitution | Depositarkode | Depositarens kode-type | Mængde | Pariværdi | Langsigtet aktieinvestering |
|---------------|-------------------|------------|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------|------------------|------------------|---------------|------------------------|--------|-----------|-----------------------------|
| C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0121 | C0122 | C0130 | C0140 | C0145 |
| | | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Vurderingsmetode | Anskaffelsesværdi | Samlet Solvens II-værdi | Påløbne renter |
|------------------|-------------------|-------------------------|----------------|
| C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| | | | |

Oplysninger om aktiver

| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Betegnelse for posten | Udsteders navn | Udsteder-kode | udstederko-detype | Udstedersek-tor | Udsteder-gruppe | Udsteder-gruppekode | Type udste-dergruppe-kode | Udsteder-land | Valuta | CIC | Tilgang ved beregningen af solvenskapitalkrav for et kollektivt investeringsinstitut (CIU) |
|---------------|-------------------|-----------------------|----------------|---------------|-------------------|-----------------|-----------------|---------------------|---------------------------|---------------|--------|-------|--|
| C0040 | C0050 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0292 |
| | | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Bestem-melser om bail-in | Regionale regeringer og lokale myndighe-der | Kryptoak-tiver | Ejendoms-type | Ejendom-mens beliggen-hed | Infrastruku-rinvestering | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinter-esser | Ekstern rating | Udpeget ECAI | Kreditkvali-tetstrin | Intern vurdering | Varighed | Solvens II-pris pr. enhed | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed |
|--------------------------|---|----------------|---------------|---------------------------|--------------------------|--|----------------|--------------|----------------------|------------------|----------|---------------------------|--|
| C0293 | C0294 | C0295 | C0296 | C0297 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 | C0370 | C0380 |
| | | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| |
|-------------|
| Udløbs-dato |
| C0390 |
| |

S.06.02.04

Liste over aktiver

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Aktiv-ID-kodetype | Portefølje | Fondsnummer | Matchningsportefølje-nummer | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | Aktiv stillet som sikkerhed | Deponeringsland | Depotinstitution |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------|-------------|-----------------------------|---|-----------------------------|-----------------|------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 |
| | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Depositarkode | Depositarens kodetype | Mængde | Pariværdi | Langsigtet aktieinvestering | Vurderingsmetode | Anskaffelsesværdi | Samlet Solvens II-værdi | Påløbne renter |
|---------------|-----------------------|--------|-----------|-----------------------------|------------------|-------------------|-------------------------|----------------|
| C0121 | C0122 | C0130 | C0140 | C0145 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| | | | | | | | | |

Oplysninger om aktiver

| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Betegnelse for posten | Udsteders navn | Udstederkode | udstederkodetype | Udstedersektor | Udstedergruppe | Udstedergruppekode | Type udstedergruppekode | Udstederland | Valuta | CIC | (forts.) |
|---------------|-------------------|-----------------------|----------------|--------------|------------------|----------------|----------------|--------------------|-------------------------|--------------|--------|-------|----------|
| C0040 | C0050 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | |
| | | | | | | | | | | | | | |

| Bestemmelser om bail-in | Regionale regeringer og lokale myndigheder | Kryptoaktiver | Ejendoms-type | Ejendommens beliggenhed | Infrastrukturinvestering | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser | Ekstern rating | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering | Varighed | Solvens II-pris pr. enhed | (forts.) |
|-------------------------|--|---------------|---------------|-------------------------|--------------------------|---|----------------|--------------|---------------------|------------------|----------|---------------------------|----------|
| C0293 | C0294 | C0295 | C0296 | C0297 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 | C0370 | |
| | | | | | | | | | | | | | |

| Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | Udløbsdato |
|--|------------|
| C0380 | C0390 |
| | |

S.06.03.01**Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode**

| UCI-ID-kode | ID-kodetype for kollektivt investeringselskab | Kategori for underliggende aktiv | Udstedelsesland | Valuta | Samlet beløb |
|-------------|---|----------------------------------|-----------------|--------|--------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| | | | | | |

S.06.03.04**Kollektive investeringsinstitutter — Se-igennem-metode**

| UCI-ID-kode | ID-kodetype for kollektivt investeringselskab | Kategori for underliggende aktiv | Udstedelsesland | Valuta | Samlet beløb |
|-------------|---|----------------------------------|-----------------|--------|--------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| | | | | | |

S.06.04.01**Risici som følge af klimaændringer i relation til investeringer**

| | | C0010 |
|--|--------------|-------|
| Overgangsrisici som følge af klimaændringer — KPI | R0010 | |
| Fysiske risici som følge af klimaændringer — KPI | R0020 | |
| Begrundelse for ikke at indberette overgangsrisici som følge af klimaændringer — KPI | R0030 | |
| Begrundelse for ikke at indberette fysiske risici som følge af klimaændringer — KPI | R0040 | |

S.07.01.01

Strukturerede produkter

| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Sikkerhedsstillelsestype | Type struktureret produkt | Kapitalbeskyttelse | Underliggende værdipapir/indeks/portefølje | Callable eller putable | Syntetisk struktureret produkt | Struktureret produkt med førtidig indfrielse | Værdi af sikkerhedsstillelse | Sikkerhedsstillelse på porteføljebasis | Fast årligt afkast | Variabelt årligt afkast | Tab givet misligholdelse | Attachment point | Detachment point |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------------|--------------------|--|------------------------|--------------------------------|--|------------------------------|--|--------------------|-------------------------|--------------------------|------------------|------------------|
| C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| | | | | | | | | | | | | | | | |

S.07.01.04

Strukturerede produkter

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Sikkerhedsstillelsestype | Type struktureret produkt | Kapitalbeskyttelse | Underliggende værdipapir/indeks/portefølje | Callable eller putable |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------------|--------------------|--|------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Syntetisk struktureret produkt | Struktureret produkt med førtidig indfrielse | Værdi af sikkerhedsstillelse | Sikkerhedsstillelse på porteføljebasis | Fast årligt afkast | Variabelt årligt afkast | Tab givet misligholdelse | Attachment point | Detachment point |
|--------------------------------|--|------------------------------|--|--------------------|-------------------------|--------------------------|------------------|------------------|
| C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| | | | | | | | | |

S.08.01.01

Åbne derivater

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Derivat-ID-kode | Entydig transaktionsidentifikator (Unique transaction identifier) | Derivat-ID-kodetype | Portefølje | Fondsnummer | Derivater i unit-linked og indeksregulerede aftaler | Underliggende instrument for derivatet | Kodetype for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet. | Brug af derivat | Notionelt beløb for derivatet | Køber/sælger | (forts.) |
|-----------------|---|---------------------|------------|-------------|---|--|--|-----------------|-------------------------------|--------------|----------|
| C0040 | C0041 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0131 | C0140 | |
| | | | | | | | | | | | |

| Til dato betalt præmie | Til dato modtaget præmie | Antal kontrakter | Kontraktstørrelse | Maksimalt tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling | Swap — Udgående beløbsstrømme | Swap — Indgående beløbsstrømme | Begyndelsesdato | Varighed | Solvens II-værdi | Vurderingsmetode |
|------------------------|--------------------------|------------------|-------------------|--|-------------------------------|--------------------------------|-----------------|----------|------------------|------------------|
| C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| | | | | | | | | | | |

Oplysninger om derivater

| Derivat-ID-kode | Derivat-ID-kodetype | Modpartens navn | Modpartskode | Modpartskodetype | Ekstern rating | Udpeget ECAI | Kreditkvalitets-trin | Intern vurdering | Modpartsgruppe | Modpartsgruppekode | (forts.) |
|-----------------|---------------------|-----------------|--------------|------------------|----------------|--------------|----------------------|------------------|----------------|--------------------|----------|
| C0040 | C0050 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | |
| | | | | | | | | | | | |

| Type modpartsgruppekode | Kontrakt navn | Valuta | Valuta for prisen | CIC | Den udløsende værdi | Udløsende værdi, der fører til afvikling af kontrakten | Udløbsdato | Swap, leveret | swap modtaget |
|-------------------------|---------------|--------|-------------------|-------|---------------------|--|------------|---------------|---------------|
| C0350 | C0360 | C0370 | C0371 | C0380 | C0390 | C0400 | C0430 | C0440 | C0450 |
| | | | | | | | | | |

S.08.04.01

Åbne derivater

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Derivat-ID-kode | Entydig transaktionsidentifikator (Unique transaction identifier) | Derivat-ID-kodetype | Portefølje | Fondsnummer | Derivater i unit-linked og indeksregulerede aftaler | Underliggende instrument for derivatet | Kodetype for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet. |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|-----------------|---|---------------------|------------|-------------|---|--|--|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0041 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Brug af derivat | Notionelt beløb for derivatet | Køber/sælger | Til dato betalt præmie | Til dato modtaget præmie | Antal kontrakter | Kontraktstørrelse | Maksimalt tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling | Swap — Udgående beløbsstrømme | Swap — Indgående beløbsstrømme | Begyndelsesdato |
|-----------------|-------------------------------|--------------|------------------------|--------------------------|------------------|-------------------|--|-------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| C0110 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Varighed | Solvens II-værdi | Vurderingsmetode |
|----------|------------------|------------------|
| C0230 | C0240 | C0250 |
| | | |

Oplysninger om derivater

| Derivat-ID-kode | Derivat-ID-kodetype | Modpartens navn | Modpartskode | Modpartskodetype | Ekstern rating | Udpeget ECAI | Kreditkvalitets-trin | Intern vurdering | Modparts-gruppe | Modpartsgrup-pekode |
|-----------------|---------------------|-----------------|--------------|------------------|----------------|--------------|----------------------|------------------|-----------------|---------------------|
| C0040 | C0050 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Type modpartsgrup-pekode | Kontraktnavn | Valuta | Valuta for prisen | CIC | Den udløsende værdi | Udløsende værdi, der fører til afvikling af kontrakten | Udløbsdato | Swap, leveret | swap modtaget |
|--------------------------|--------------|--------|-------------------|-------|---------------------|--|------------|---------------|---------------|
| C0350 | C0360 | C0370 | C0371 | C0380 | C0390 | C0400 | C0430 | C0440 | C0450 |
| | | | | | | | | | |

S.10.01.04

Værdipapirudlån og -genkøb

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Portefølje | Fondsnummer | Aktivkategori | Modpartens navn | Modpartskode | Modpartskodetype | Kategori for modpartens aktiv | Aktiver, der besiddes i forbindelse med unit-linked aftaler og indeksregulerede aftaler |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|------------|-------------|---------------|-----------------|--------------|------------------|-------------------------------|---|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Position i kontrakten | Near leg-beløb | Far leg-beløb | Startdato | Udløbsdato | Solvens II-værdi |
|-----------------------|----------------|---------------|-----------|------------|------------------|
| C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| | | | | | |

S.11.01.01

Aktiver, der besiddes som sikkerhed

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Oplysninger om aktiver | | | | | | | | | | Oplysninger om det aktiv, for hvilke sikkerheden besiddes |
|------------------------|-------------------|---|--|-----------------|--------|-----------|------------------|--------------|----------------|---|
| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Navn på den sikkerhedsstillende modpart | Navnet på den sikkerhedsstillende modpartsgruppe | Deponeringsland | Mængde | Pariværdi | Vurderingsmetode | Samlet beløb | Påløbne renter | Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes |
| C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | | | | | | |

Oplysninger om aktiver

| Oplysninger om aktiver | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------------|-------------------|-----------------------|----------------|---------------|-------------------|-----------------|---------------------|----------------------|---------------------------|---------------|--------|-------|----------------|--|-------------|
| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Betegnelse for posten | Udsteders navn | Udsteder-kode | udsteder-kodetype | Udsteder-sektor | Udsteder-gruppenavn | Udsteder-gruppe-kode | Type udsteder-gruppe-kode | Udsteder-land | Valuta | CIC | Pris pr. enhed | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | Udløbs-dato |
| C0040 | C0050 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 |
| | | | | | | | | | | | | | | | |

S.11.01.04

Aktiver, der besiddes som sikkerhed

Oplysninger om positioner, der besiddes

| Oplysninger om aktiver | | | | | | | | | | | | | Oplysninger om det aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------|---|--|-----------------|--------|-----------|------------------|--------------|----------------|--|
| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Navn på den sikkerhedsstillende modpart | Navnet på den sikkerhedsstillende modpartsgruppe | Deponeringsland | Mængde | Pariværdi | Vurderingsmetode | Samlet beløb | Påløbne renter | Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | | | | | | | | | |

Oplysninger om aktiver

| Oplysninger om aktiver | | | | | | | | | | | | |
|------------------------|-------------------|-----------------------|----------------|---------------|------------------|----------------|--------------------|--------------------|-------------------------|--------------|--------|-------|
| Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | Betegnelse for posten | Udsteders navn | Udsteder-kode | udstederkodetype | Udstedersektor | Udstedergruppenavn | Udstedergruppekode | Type udstedergruppekode | Udstederland | Valuta | CIC |
| C0040 | C0050 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Oplysninger om aktiver | | |
|------------------------|--|------------|
| Pris pr. enhed | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | Udløbsdato |
| C0260 | C0270 | C0280 |
| | | |

S.12.01.01

Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring

| | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | |
|---|------------------------------|---|--------------------------------------|-------|
| | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0010 | | | |
| | R0020 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | |
| Det bedste skøn | | | | |
| Bedste bruttoskøn | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0030 | | | |
| | R0040 | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab | R0050 | | | |
| | R0060 | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0070 | | | |
| | R0080 | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0090 | | | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance | R0100 | | | |
| Risikomargin | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0110 | | | |
| Bedste skøn | R0120 | | | |

| | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | |
|--|------------------------------|---|--------------------------------------|-------|
| | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Risikomargin | R0130 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0210 | | | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | R0220 | | | |
| Det bedste bruttoskøn for cash flow | | | | |
| Likviditetstab | | | | |
| Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | R0230 | | | |
| Fremtidige garanterede ydelser | R0240 | | | |
| Fremtidige diskretionære ydelser | R0250 | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0260 | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | |
| Fremtidige præmier | R0270 | | | |
| Anden likviditetstilførsel | R0280 | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | R0290 | | | |
| Genkøbsværdi | R0300 | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0310 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0320 | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | R0330 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | R0340 | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning | R0350 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre | R0360 | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0370 | | | |

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et.

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen**Det bedste skøn****Bedste bruttoskøn**

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse.

Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab

Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab

Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse.

Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance

Risikomargin**Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser**

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et

Bedste skøn

| | Anden livsforsikring | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|---|-------|
| | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | |
| | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| R0010 | | | | |
| R0020 | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| R0030 | | | | |
| R0040 | | | | |
| R0050 | | | | |
| R0060 | | | | |
| R0070 | | | | |
| R0080 | | | | |
| R0090 | | | | |
| R0100 | | | | |
| | | | | |
| R0110 | | | | |
| R0120 | | | | |

| | | Anden livsforsikring | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | |
|--|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|---|-------|
| | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | |
| | | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Risikomargin | R0130 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0210 | | | | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | R0220 | | | | |
| Det bedste bruttoskøn for cash flow | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | R0230 | | | | |
| Fremtidige garanterede ydelser | R0240 | | | | |
| Fremtidige diskretionære ydelser | R0250 | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0260 | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | R0270 | | | | |
| Anden likviditetstilførsel | R0280 | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | R0290 | | | | |
| Genkøbsværdi | R0300 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0310 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0320 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | R0330 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | R0340 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning | R0350 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre | R0360 | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0370 | | | | |

| | Accepteret genforsikring | | | |
|---|------------------------------|---|----------------------|-------|
| | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | Anden livsforsikring | |
| | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | |
| R0010 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | | | | |
| R0020 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | |
| Det bedste skøn | | | | |
| Bedste bruttoskøn | | | | |
| R0030 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | |
| R0040 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab | | | | |
| R0050 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | | | | |
| R0060 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab | | | | |
| R0070 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | |
| R0080 | | | | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance | | | | |
| R0090 | | | | |
| Risikomargin | | | | |
| R0100 | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | |
| R0110 | | | | |

| | | Accepteret genforsikring | | | |
|--|--------------|------------------------------|---|----------------------|-------|
| | | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | Anden livsforsikring | |
| | | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Bedste skøn | R0120 | | | | |
| Risikomargin | R0130 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0210 | | | | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | R0220 | | | | |
| Det bedste bruttoskøn for cash flow | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | R0230 | | | | |
| Fremtidige garanterede ydelser | R0240 | | | | |
| Fremtidige diskretionære ydelser | R0250 | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0260 | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | R0270 | | | | |
| Anden likviditetstilførsel | R0280 | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | R0290 | | | | |
| Genkøbsværdi | R0300 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0310 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0320 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | R0330 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | R0340 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning | R0350 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre | R0360 | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0370 | | | | |

| | Accepteret genforsikring | |
|---|---|---|
| | Annuiteter hidrørende fra accepterede skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | I alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) |
| | C0140 | C0150 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | |
| R0010 | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | | |
| R0020 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | |
| Det bedste skøn | | |
| Bedste bruttoskøn | | |
| R0030 | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | |
| R0040 | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab | | |
| R0050 | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | | |
| R0060 | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab | | |
| R0070 | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | |
| R0080 | | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance | | |
| R0090 | | |
| Risikomargin | | |
| R0100 | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | |
| R0110 | | |
| Bedste skøn | | |
| R0120 | | |
| Risikomargin | | |
| R0130 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | |
| R0200 | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | | |
| R0210 | | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | | |
| R0220 | | |

Det bedste bruttoskøn for cash flow

Likviditetstab

Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser

Fremtidige garanterede ydelser

Fremtidige diskretionære ydelser

Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab

Likviditetstilførsel

Fremtidige præmier

Anden likviditetstilførsel

Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser

Genkøbsværdi

Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen

Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen

Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering

Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger

Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning

Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier

| | Accepteret genforsikring | |
|--------------|---|---|
| | Annuiteter hidrørende fra accepterede skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | I alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) |
| | C0140 | C0150 |
| | | |
| | | |
| R0230 | | |
| R0240 | | |
| R0250 | | |
| R0260 | | |
| | | |
| R0270 | | |
| R0280 | | |
| R0290 | | |
| R0300 | | |
| R0310 | | |
| R0320 | | |
| R0330 | | |
| R0340 | | |
| R0350 | | |
| R0360 | | |
| R0370 | | |

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et.

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen**Det bedste skøn****Bedste bruttoskøn**

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse.

Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab

Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab

Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab

Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse.

Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance

Risikomargin**Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser**

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et

Bedste skøn

Risikomargin

| | Sygeforsikring (direkte virksomhed) | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser | |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--|-------|
| | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | |
| | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| R0010 | | | | |
| R0020 | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| R0030 | | | | |
| R0040 | | | | |
| R0050 | | | | |
| R0060 | | | | |
| R0070 | | | | |
| R0080 | | | | |
| R0090 | | | | |
| R0100 | | | | |
| | | | | |
| R0110 | | | | |
| R0120 | | | | |
| R0130 | | | | |

| | | Sygeforsikring (direkte virksomhed) | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser | |
|--|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--|-------|
| | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | |
| | | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0210 | | | | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | R0220 | | | | |
| Det bedste bruttoskøn for cash flow | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | R0230 | | | | |
| Fremtidige garanterede ydelser | R0240 | | | | |
| Fremtidige diskretionære ydelser | R0250 | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0260 | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | R0270 | | | | |
| Anden likviditetstilførsel | R0280 | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | R0290 | | | | |
| Genkøbsværdi | R0300 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0310 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0320 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | R0330 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | R0340 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning | R0350 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre | R0360 | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0370 | | | | |

| | Sygeforsikring (accepteret genforsikring) | I alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) |
|---|--|--|
| | C0200 | C0210 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | |
| | R0010 | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0020 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | |
| Det bedste skøn | | |
| Bedste bruttoskøn | R0030 | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0040 | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab | R0050 | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0060 | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab | R0070 | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0080 | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance | R0090 | |
| Risikomargin | R0100 | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0110 | |
| Bedste skøn | R0120 | |
| Risikomargin | R0130 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0210 | |
| Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | R0220 | |
| Det bedste bruttoskøn for cash flow | | |
| Likviditetstab | | |
| Fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | R0230 | |

Fremtidige garanterede ydelser

Fremtidige diskretionære ydelser

Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab

Likviditetstilførsel

Fremtidige præmier

Anden likviditetstilførsel

Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser

Genkøbsværdi

Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen

Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen

Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering

Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger

Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning

Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier

| | Sygeforsikring (accepteret genforsikring) | I alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) |
|--------------|--|--|
| | C0200 | C0210 |
| R0240 | | |
| R0250 | | |
| R0260 | | |
| R0270 | | |
| R0280 | | |
| R0290 | | |
| R0300 | | |
| R0310 | | |
| R0320 | | |
| R0330 | | |
| R0340 | | |
| R0350 | | |
| R0360 | | |
| R0370 | | |

S.12.01.02

Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring

| Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | Anden livsforsikring | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser |
|---|---|--------------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------|---|
| | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0020 | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | | |
| Det bedste skøn | | | | | | | |
| Bedste bruttoskøn | R0030 | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0080 | | | | | | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — I alt | R0090 | | | | | | |
| Risikomargin | R0100 | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | | | | |

(forts.)

SR.12.01.01

Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring

Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del **Z0020**

Fonds-/porteføljenummer **Z0030**

| |
|--|
| |
| |

| Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | Anden livsforsikring | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | |
|--|---|--------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------|---|-------|
| | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | | |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et R0010 | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. R0020 | | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | | |
| Det bedste skøn | | | | | | | |
| Bedste bruttoskøn R0030 | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. R0080 | | | | | | | |

(forts.)

| Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | Anden livsforsikring | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser |
|---|---|---------------------------------------|--------------------------------------|----------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|---|
| | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | | Aftaler uden optioner eller garantier | Aftaler med optioner eller garantier | |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — I alt | R0090 | | | | | | |
| Risikomargin | R0100 | | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0110 | | | | | | |
| Bedste skøn | R0120 | | | | | | |
| Risikomargin | R0130 | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0200 | | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0370 | | | | | | |

(forts.)

| | Accepteret genforsikring | I alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Sygeforsikring (direkte virksomhed) | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser | Sygeforsikring (accepteret genforsikring) | I alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | |
|---|--------------------------|---|-------------------------------------|---------------------------------------|--|---|--|--------------------------------------|
| | | | | Aftaler uden optioner eller garantier | | | | Aftaler med optioner eller garantier |
| | C0100 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | | | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | | | |
| Det bedste skøn | | | | | | | | |
| Bedste bruttoskøn | | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | | | | |
| Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — I alt | | | | | | | | |

S.12.02.01

Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring — Efter land

Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — Hjemland og lande uden for væsentlighedstærsklen

| Geografisk zone/land | | | Forsikring med gevinstandele | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | Anden livsforsikring | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser | Accepteret genforsikring |
|---|-------|-------|------------------------------|---|----------------------|---|--------------------------|
| | | | C0020 | C0030 | C0060 | C0090 | C0100 |
| Hjemland | R0010 | | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0020 | | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0030 | | | | | | |
| | | | | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | | C0010 | | | | | |
| Land 1 | R0040 | | | | | | |
| ... | ... | | | | | | |

(forts.)

| Geografisk zone/land | | | Sygeforsikring (direkte virksomhed) | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser | Sygeforsikring (accepteret genforsikring) |
|---|--------------|--------------|--|--|--|
| | | | C0160 | C0190 | C0200 |
| Hjemland | R0010 | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0020 | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0030 | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | | C0010 | | | |
| Land 1 | R0040 | | | | |
| ... | ... | | | | |

S.13.01.01

Fremskrivning af fremtidige cash flow, opgjort brutto

| | | Forsikring med gevinstandele | | | | | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | | | | |
|--|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0011 | C0015 | C0020 | C0030 | C0040 | C0045 | C0051 | C0055 | C0060 | C0070 | C0080 | C0085 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | R0010 | | | | | | | | | | | | |
| 2 | R0020 | | | | | | | | | | | | |
| 3 | R0030 | | | | | | | | | | | | |
| 4 | R0040 | | | | | | | | | | | | |
| 5 | R0050 | | | | | | | | | | | | |
| 6 | R0060 | | | | | | | | | | | | |
| 7 | R0070 | | | | | | | | | | | | |
| 8 | R0080 | | | | | | | | | | | | |
| 9 | R0090 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Forsikring med gevinstandele | | | | | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | | | | |
|----|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0011 | C0015 | C0020 | C0030 | C0040 | C0045 | C0051 | C0055 | C0060 | C0070 | C0080 | C0085 |
| 10 | R0100 | | | | | | | | | | | | |
| 11 | R0110 | | | | | | | | | | | | |
| 12 | R0120 | | | | | | | | | | | | |
| 13 | R0130 | | | | | | | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | | | | | | | | |
| 15 | R0150 | | | | | | | | | | | | |
| 16 | R0160 | | | | | | | | | | | | |
| 17 | R0170 | | | | | | | | | | | | |
| 18 | R0180 | | | | | | | | | | | | |
| 19 | R0190 | | | | | | | | | | | | |
| 20 | R0200 | | | | | | | | | | | | |
| 21 | R0210 | | | | | | | | | | | | |
| 22 | R0220 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Forsikring med gevinstandele | | | | | Indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | | | | |
|--------------|--------------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0011 | C0015 | C0020 | C0030 | C0040 | C0045 | C0051 | C0055 | C0060 | C0070 | C0080 | C0085 |
| 23 | R0230 | | | | | | | | | | | | |
| 24 | R0240 | | | | | | | | | | | | |
| 25 | R0250 | | | | | | | | | | | | |
| 26 | R0260 | | | | | | | | | | | | |
| 27 | R0270 | | | | | | | | | | | | |
| 28 | R0280 | | | | | | | | | | | | |
| 29 | R0290 | | | | | | | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | | | | | | | | |
| 31-40 | R0310 | | | | | | | | | | | | |
| 41-50 | R0320 | | | | | | | | | | | | |
| 51 og senere | R0330 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Anden livsforsikring | | | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler | | | | | | |
|--|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|--|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|-------|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | |
| | | C0091 | C0095 | C0100 | C0110 | C0120 | C0125 | C0131 | C0135 | C0140 | C0150 | C0160 | C0165 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | R0010 | | | | | | | | | | | | |
| 2 | R0020 | | | | | | | | | | | | |
| 3 | R0030 | | | | | | | | | | | | |
| 4 | R0040 | | | | | | | | | | | | |
| 5 | R0050 | | | | | | | | | | | | |
| 6 | R0060 | | | | | | | | | | | | |
| 7 | R0070 | | | | | | | | | | | | |
| 8 | R0080 | | | | | | | | | | | | |
| 9 | R0090 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Anden livsforsikring | | | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler | | | | | | |
|----|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0091 | C0095 | C0100 | C0110 | C0120 | C0125 | C0131 | C0135 | C0140 | C0150 | C0160 | C0165 |
| 10 | R0100 | | | | | | | | | | | | |
| 11 | R0110 | | | | | | | | | | | | |
| 12 | R0120 | | | | | | | | | | | | |
| 13 | R0130 | | | | | | | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | | | | | | | | |
| 15 | R0150 | | | | | | | | | | | | |
| 16 | R0160 | | | | | | | | | | | | |
| 17 | R0170 | | | | | | | | | | | | |
| 18 | R0180 | | | | | | | | | | | | |
| 19 | R0190 | | | | | | | | | | | | |
| 20 | R0200 | | | | | | | | | | | | |
| 21 | R0210 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Anden livsforsikring | | | | | Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler | | | | | | |
|--------------|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|--|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|-------|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | |
| | | C0091 | C0095 | C0100 | C0110 | C0120 | C0125 | C0131 | C0135 | C0140 | C0150 | C0160 | C0165 |
| 22 | R0220 | | | | | | | | | | | | |
| 23 | R0230 | | | | | | | | | | | | |
| 24 | R0240 | | | | | | | | | | | | |
| 25 | R0250 | | | | | | | | | | | | |
| 26 | R0260 | | | | | | | | | | | | |
| 27 | R0270 | | | | | | | | | | | | |
| 28 | R0280 | | | | | | | | | | | | |
| 29 | R0290 | | | | | | | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | | | | | | | | |
| 31-40 | R0310 | | | | | | | | | | | | |
| 41-50 | R0320 | | | | | | | | | | | | |
| 51 og senere | R0330 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Accepteret genforsikring | | | | | Sygeforsikring | | | | | | |
|--|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0171 | C0175 | C0180 | C0190 | C0200 | C0205 | C0211 | C0215 | C0220 | C0230 | C0240 | C0245 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | R0010 | | | | | | | | | | | | |
| 2 | R0020 | | | | | | | | | | | | |
| 3 | R0030 | | | | | | | | | | | | |
| 4 | R0040 | | | | | | | | | | | | |
| 5 | R0050 | | | | | | | | | | | | |
| 6 | R0060 | | | | | | | | | | | | |
| 7 | R0070 | | | | | | | | | | | | |
| 8 | R0080 | | | | | | | | | | | | |
| 9 | R0090 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Accepteret genforsikring | | | | | Sygeforsikring | | | | | | |
|----|--------------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0171 | C0175 | C0180 | C0190 | C0200 | C0205 | C0211 | C0215 | C0220 | C0230 | C0240 | C0245 |
| 10 | R0100 | | | | | | | | | | | | |
| 11 | R0110 | | | | | | | | | | | | |
| 12 | R0120 | | | | | | | | | | | | |
| 13 | R0130 | | | | | | | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | | | | | | | | |
| 15 | R0150 | | | | | | | | | | | | |
| 16 | R0160 | | | | | | | | | | | | |
| 17 | R0170 | | | | | | | | | | | | |
| 18 | R0180 | | | | | | | | | | | | |
| 19 | R0190 | | | | | | | | | | | | |
| 20 | R0200 | | | | | | | | | | | | |
| 21 | R0210 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Accepteret genforsikring | | | | | Sygeforsikring | | | | | | |
|--------------|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0171 | C0175 | C0180 | C0190 | C0200 | C0205 | C0211 | C0215 | C0220 | C0230 | C0240 | C0245 |
| 22 | R0220 | | | | | | | | | | | | |
| 23 | R0230 | | | | | | | | | | | | |
| 24 | R0240 | | | | | | | | | | | | |
| 25 | R0250 | | | | | | | | | | | | |
| 26 | R0260 | | | | | | | | | | | | |
| 27 | R0270 | | | | | | | | | | | | |
| 28 | R0280 | | | | | | | | | | | | |
| 29 | R0290 | | | | | | | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | | | | | | | | |
| 31-40 | R0310 | | | | | | | | | | | | |
| 41-50 | R0320 | | | | | | | | | | | | |
| 51 og senere | R0330 | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Sygegenforsikring | | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | C0290 | |
|--|-------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|-------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | | |
| | | C0251 | C0255 | C0260 | C0270 | C0280 | | | C0285 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | |
| 1 | R0010 | | | | | | | | |
| 2 | R0020 | | | | | | | | |
| 3 | R0030 | | | | | | | | |
| 4 | R0040 | | | | | | | | |
| 5 | R0050 | | | | | | | | |
| 6 | R0060 | | | | | | | | |
| 7 | R0070 | | | | | | | | |
| 8 | R0080 | | | | | | | | |
| 9 | R0090 | | | | | | | | |

| | | Sygegenforsikring | | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | C0290 | |
|--|--------------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|-------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | | |
| | | C0251 | C0255 | C0260 | C0270 | C0280 | | | C0285 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | |
| 10 | R0100 | | | | | | | | |
| 11 | R0110 | | | | | | | | |
| 12 | R0120 | | | | | | | | |
| 13 | R0130 | | | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | | | | |
| 15 | R0150 | | | | | | | | |
| 16 | R0160 | | | | | | | | |
| 17 | R0170 | | | | | | | | |
| 18 | R0180 | | | | | | | | |

| | | Sygegenforsikring | | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | C0290 | |
|--|--------------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|-------|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | | |
| | | C0251 | C0255 | C0260 | C0270 | C0280 | | | C0285 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | |
| 19 | R0190 | | | | | | | | |
| 20 | R0200 | | | | | | | | |
| 21 | R0210 | | | | | | | | |
| 22 | R0220 | | | | | | | | |
| 23 | R0230 | | | | | | | | |
| 24 | R0240 | | | | | | | | |
| 25 | R0250 | | | | | | | | |
| 26 | R0260 | | | | | | | | |
| 27 | R0270 | | | | | | | | |

| | | Sygegenforsikring | | | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | |
|--|--------------|--------------------------------|----------------------------------|---|----------------------|----------------------------|---|---|
| | | Likviditetstab | | | Likviditetstilførsel | | | |
| | | Fremtidige garanterede ydelser | Fremtidige diskretionære ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
| | | C0251 | C0255 | C0260 | C0270 | C0280 | | C0285 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | |
| 28 | R0280 | | | | | | | |
| 29 | R0290 | | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | | | |
| 31-40 | R0310 | | | | | | | |
| 41-50 | R0320 | | | | | | | |
| 51 og senere | R0330 | | | | | | | |

S.14.01.01

Analyse af livsforsikringsforpligtelser

Portefølje

| Produkt-ID-kode | Branche | Antal aftaler ved årets udgang | Antal aftaler ved udgangen af året — heraf antal aftaler med en genkøbsoption | Antal nye aftaler i løbet af året | Antal aftaler genkøbt i løbet af året. | Antal forsikrede ved årets udgang | Skattemæssig behandling af produkterne | Land |
|-----------------|---------|--------------------------------|---|-----------------------------------|--|-----------------------------------|--|-------|
| C0010 | C0030 | C0040 | C0041 | C0050 | C0051 | C0054 | C0055 | C0080 |
| | | | | | | | | |

Porteføljeprodukter

| Fondsnummer | Samlet værdi af tegnede præmier | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet direkte af forsikringsselskabet | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet via kreditinstitutter | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet via andre forsikringsdistributører | Samlet værdi af udbetalte erstatninger i løbet af året | Samlet værdi af udbetalt provision i løbet af året | Forventede fremtidige præmier |
|-------------|---------------------------------|---|---|--|--|--|-------------------------------|
| C0020 | C0060 | C0061 | C0062 | C0063 | C0070 | C0071 | C0075 |
| | | | | | | | |

(forts.)

| Forventede fremtidige provisioner | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser under et | Risikosum | Genkøbsværdi | Garanteret rente — Garanteret rente på årsbasis (i den gennemsnitlige varighed af garantien) | Garanteret rente — Årlig garanteret rentesats for indberetningsåret | Udtrædelsesbetingelser på indberetningsdatoen | Beløb, for hvilke der er garanteret rente |
|-----------------------------------|---|-----------|--------------|--|---|---|---|
| C0077 | C0180 | C0190 | C0200 | C0260 | C0261 | C0270 | C0280 |
| | | | | | | | |

Produktets karakteristika

| Produktklassifikation | Pensionsrettigheder | Produkttype | Produktbetegnelse | Markedsføres produktet stadig? | Udbyttedeling | Kontraktlig restløbetid |
|-----------------------|---------------------|-------------|-------------------|--------------------------------|---------------|-------------------------|
| C0101 | C0102 | C0110 | C0120 | C0130 | C0141 | C0142 |
| | | | | | | |

S.14.02.01

Analyse af skadesforsikringsforpligtelser

Portefølje

| Branche | Heraf produkt-kategori | For produkter, der er markedsført under denne produktkategori/branche, hvilken andel heraf omfatter klimarelaterede risici (målt ved tegnede bruttopræmier)? (0-100) | Hvis produktet dækker klimarelaterede risici, giver produktets udformning mulighed for risiciforebyggelse? (Ja/Nej/Ikke relevant) | Antal aftaler ved årets udgang | Antal nye aftaler i løbet af året | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet direkte af forsikrings-selskabet | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet via kreditinstitutter |
|---------|------------------------|--|---|--------------------------------|-----------------------------------|--|---|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | |

(forts.)

| Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet via forsikringsdistributører, som ikke er kreditinstitutter | Samlet værdi af udbetalt provision i løbet af året | Samlet værdi af udbetalte erstatninger i løbet af året | Land | Oplysninger om antal forsikrede | |
|---|--|--|-------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| | | | | Antal forsikrede ved årets udgang | Antal forsikrede ved årets udgang |
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | |

S.14.03.01

Cyberforsikringsrisiko

Cyberrisici — risikoidentifikation

| Produktgruppekode | Målmarked | Produktidentifikation | Dækning af cyberrisici i produktkategorien | Branche(r) | Beskrivelse af risiko/risici i dækningen | Beskrivelse af andre risici | Forsikringssum |
|-------------------|-----------|-----------------------|--|------------|--|-----------------------------|----------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | |

(forts.)

| Præmie(r) | Genforsikringssum | Antal krav, der er afregnet med betaling | Beløb for udbetalte erstatninger | Antal krav, der er afregnet uden betaling | Forsikringsmæssige hensættelser |
|-----------|-------------------|--|----------------------------------|---|---------------------------------|
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | |

S.16.01.01

Oplysninger om annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsvirksomhed

| | | |
|---|-------|--|
| Den tilknyttede skadesforsikrings- branche | Z0010 | |
| Ulykkesår/forsikringsår | Z0020 | |
| Valuta | Z0030 | |
| Valutaomregning | Z0040 | |

Oplysninger om år N:

C0010

| | | |
|--|-------|--|
| Gennemsnitlig rentesats | R0010 | |
| Forpligtelsernes gennemsnitlige varighed. | R0020 | |
| De begunstigedes vægtede gennem- snitlige alder | R0030 | |

Oplysninger om annuiteter

| År | | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved begyndelsen af år N | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav fore- taget i løbet af år N | Annuitetsbeta- linger betalt i løbet af år N | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N | Antal annuitetsfor- pligtelser ved udgangen af år N | Det bedste skøn over hensættelser til annuitets- krav ved udgangen af år N (diskonteret grundlag) | Udiskonterede udviklingsresul- tater |
|-----------------------|-------|---|---|--|--|---|--|--|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Tidligere regnskabsår | R0040 | | | | | | | |
| N-14 | R0050 | | | | | | | |
| N-13 | R0060 | | | | | | | |
| N-12 | R0070 | | | | | | | |

| År | | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved begyndelsen af år N | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav fore- taget i løbet af år N | Annuitetsbeta- linger betalt i løbet af år N | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N | Antal annuitetsfor- pligtelser ved udgangen af år N | Det bedste skøn over hensættelser til annuitets- krav ved udgangen af år N (diskonteret grundlag) | Udiskonterede udviklingsresul- tater |
|-------|--------------|---|---|--|--|---|--|--|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| N-11 | R0080 | | | | | | | |
| N-10 | R0090 | | | | | | | |
| N-9 | R0100 | | | | | | | |
| N-8 | R0110 | | | | | | | |
| N-7 | R0120 | | | | | | | |
| N-6 | R0130 | | | | | | | |
| N-5 | R0140 | | | | | | | |
| N-4 | R0150 | | | | | | | |
| N-3 | R0160 | | | | | | | |
| N-2 | R0170 | | | | | | | |
| N-1 | R0180 | | | | | | | |
| N | R0190 | | | | | | | |
| I alt | R0200 | | | | | | | |

S.17.01.01

Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|--|
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvarsfor-sikring | Anden motorfor-sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik-ring | |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | | | |
| Direkte virksomhed | R0020 | | | | | |
| Accepteret proportional genforsikring | R0030 | | | | | |
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0040 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0050 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | | | |
| Brutto — I alt | R0060 | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0070 | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0080 | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0090 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0100 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|---|---|------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|
| | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvarsfor-sikring | Anden motorfor-sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik-ring |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | R0110 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0120 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | R0130 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0140 | | | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | R0150 | | | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | | | |
| Brutto — I alt | R0160 | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0170 | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0180 | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0190 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | | | |
| Direkte virksomhed | R0020 | | | | | |
| Accepteret proportional genforsikring | R0030 | | | | | |
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0040 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0050 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | | | |
| Brutto — I alt | R0060 | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0070 | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0080 | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0090 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0100 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | R0110 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|---|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0120 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | R0130 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0140 | | | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | R0150 | | | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | | | |
| Brutto — I alt | R0160 | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0170 | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0180 | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0190 | | | | | |

| | | | | | Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|--|--------------|--|--|--|---|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|
| | | | | | Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | |
| | | | | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | | | | | | |
| Direkte virksomhed | R0020 | | | | | | | | |
| Accepteret proportional genforsikring | R0030 | | | | | | | | |
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0040 | | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0050 | | | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | | | | | | |
| Brutto — I alt | R0060 | | | | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | R0070 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | R0080 | | | | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | R0090 | | | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0100 | | | | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | R0110 | | | | | | | | |

| | | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|---|------------------------------------|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | | |
| | Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | |
| | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | | | | | |
| R0120 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | | | | | |
| R0130 | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | |
| R0140 | | | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | | | | | |
| R0150 | | | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | | |
| Brutto — I alt | | | | | |
| R0160 | | | | | |
| Brutto — Direkte virksomhed | | | | | |
| R0170 | | | | | |
| Brutto — Accepteret proportional genforsikring | | | | | |
| R0180 | | | | | |
| Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | | |
| R0190 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|---|--|------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|--|
| | Forsikring vedrørende udgifter til læge- behandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskadefor- sikring | Motoransvarsfor- sikring | Anden motorfor- sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik- ring |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | | |
| R0200 | | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | | | | | | |
| R0210 | | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | | | | | | |
| R0220 | | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | | | | | | |
| R0230 | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | | |
| R0240 | | | | | | |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | | | | | | |
| R0250 | | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | | | | | | |
| R0260 | | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | | | | | | |
| R0270 | | | | | | |
| Risikomargin | | | | | | |
| R0280 | | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser under et | | | | | | |
| R0290 | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | |
| R0300 | | | | | | |
| Risikomargin | | | | | | |
| R0310 | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| R0320 | | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | |
|--|------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvarsfor-sikring | Anden motorfor-sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik-ring |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | | | | | |
| | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | | | | | |
| | | | | | |
| Branche: yderligere segmentering (homogene risikogrupper) | | | | | |
| Præmiehensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | | | | | |
| Erstatningshensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | | | | | |
| | | | | | |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) | | | | | |
| | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | | | | | |
| | | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | | | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | |
|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0200 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | R0210 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0220 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | R0230 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0240 | | | | |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | R0250 | | | | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser under et | R0290 | | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | |
|--|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | | |
| Branche: yderligere segmentering (homogene risikogrupper) | | | | | |
| Præmiehensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | R0350 | | | | |
| Erstatningshensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | R0360 | | | | |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | R0370 | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0380 | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | R0390 | | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | R0400 | | | | |

| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|---|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|
| Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | |
| C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0200 | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justering for forventede tab | R0210 | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | R0220 | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance, inden justering for forventede tab | R0230 | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0240 | | | |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | R0250 | | | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser under et | R0290 | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | |

| Accepteret ikkeproportional gensforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|---|--|---|---|--------------------------------------|
| Ikkeproportional sygegensforsikring | Ikkeproportional ulykkesgensforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgensforsikring | Ikkeproportional ejendomsgensforsikring | |
| C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til gensforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til gensforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | |
| Branche: yderligere segmentering (homogene risikogrupper) | | | | |
| Præmiehensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | R0350 | | | |
| Erstatningshensættelser — Samlet antal homogene risikogrupper | R0360 | | | |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) | | | | |
| Likviditetstab | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | R0370 | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0380 | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | |
| Fremtidige præmier | R0390 | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | R0400 | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|---|------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|---|
| | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskade-forsikring | Motoransvarsfor-sikring | Anden motorfor-sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik-ring |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over erstatnings-hensættelser (brutto) | | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | | | | | | |
| | | | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | | | | | | |
| | | | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | | |
| Fremtidige præmier | | | | | | |
| | | | | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | | | | | | |
| | | | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | | | | | | |
| | | | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | | | | | | |
| | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | | | | | | |
| | | | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | | | | | | |
| | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | | | | | | |
| | | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | |
|--|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | R0410 | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | R0420 | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | |
| Fremtidige præmier | R0430 | | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | R0440 | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | R0450 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0460 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | R0470 | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | R0480 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | R0490 | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0500 | | | | |

| | | | | | Accepteret ikkeproportional gensforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt | |
|--|--|--|--|--|--|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|-------|
| | | | | | Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | |
| | | | | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | | C0180 |
| Cash flow i forbindelse med bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) | | | | | | | | | | |
| Likviditetstab | | | | | | | | | | |
| Fremtidige ydelser og krav | | | | | R0410 | | | | | |
| Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | | | | | R0420 | | | | | |
| Likviditetstilførsel | | | | | | | | | | |
| Fremtidige præmier | | | | | R0430 | | | | | |
| Anden likviditetstilførsel (inklusive genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | | | | | R0440 | | | | | |
| Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | | | | | R0450 | | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | | | | | R0460 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | | | | | R0470 | | | | | |
| Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | | | | | R0480 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | | | | | R0490 | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | | | | | R0500 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|--|------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|--|
| | Forsikring vedrørende udgifter til læge- behandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskadefor- sikring | Motoransvarsfor- sikring | Anden motorfor- sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik- ring |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0290 | | | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|---|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | | | |
| | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | | | |
| Brutto | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | | | | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | | | |
| Brutto | | | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | | | | | | |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0290 | | | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | | | |

| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|--|---------------------------------------|--|--|-------|--------------------------------------|
| Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | |
| C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0290 | | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|--|------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|--|
| | Forsikring vedrørende udgifter til læge- behandling | Indkomst-sikring | Arbejdsskadefor- sikring | Motoransvarsfor- sikring | Anden motorfor- sikring | Sø-, luftfarts- og transportforsik- ring |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | | | | | | |
| Risikomargin | | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | | |
| Risikomargin | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | | | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | |
|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0050 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | | |
| Brutto | R0060 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0140 | | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | R0150 | | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | | |
| Brutto | R0160 | | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0240 | | | | |

| Direkte virksomhed og accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
|--|---|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------|------------------------|
| | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom | Almindelig ansvarsforsikring | Kredit- og kautionsforsikring | Retshjælpsforsikring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | R0250 | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Brutto | R0260 | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | R0270 | | | | | |
| Risikomargin | R0280 | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0290 | | | | | |
| Bedste skøn | R0300 | | | | | |
| Risikomargin | R0310 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | R0320 | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | R0330 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | R0340 | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | R0500 | | | | | |

| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|---|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|
| Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | |
| C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0010 | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | R0050 | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af bedste skøn og risikomarginen | | | | |
| Bedste skøn | | | | |
| Præmiehensættelser | | | | |
| Brutto | R0060 | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0140 | | | |
| Bedste nettoskøn over præmiehensættelser | R0150 | | | |
| Erstatningshensættelser | | | | |
| Brutto | R0160 | | | |
| Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | R0240 | | | |
| Bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | R0250 | | | |

| | Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | Skadesforsikringsforpligtelser i alt |
|--|---|---------------------------------------|--|--|--------------------------------------|
| | Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | |
| | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Bedste skøn i alt — Brutto | | | | | |
| Bedste skøn i alt — Netto | | | | | |
| Risikomargin | | | | | |
| Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | | | | | |
| Bedste skøn | | | | | |
| Risikomargin | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | | | | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | | | | | |
| Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | | | | | |

S.17.02.01

Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring — Efter land

Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — Hjemland og lande uden for væsentlighedstærsklen

| | |
|-----------------|-------|
| Land ... | C0010 |
| Type virksomhed | Z0010 |

| Geografisk zone/land | | Direkte virksomhed | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|---|-----------------|------------------------|------------------------|-----------------------|--|---|
| | | | Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling | Indkomstsikring | Arbejdsskadeforsikring | Motoransvarsforsikring | Anden motorforsikring | Sø-, luftfarts- og transportforsikring | Forsikring mod brand og andre skader på ejendom |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Direkte virksomhed | | | | | | | | | |
| Hjemland | R0010 | | | | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0020 | | | | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0030 | | | | | | | | |
| Accepteret proportional genforsikring | | | | | | | | | |
| Hjemland | R0041 | | | | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0050 | | | | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0060 | | | | | | | | |

| Geografisk zone/land | | | Direkte virksomhed | | | | |
|---|--------------|-------|--------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------|------------|---------------------------|
| | | | Almindelig ansvarsfor- sikring | Kredit- og kautionsfor- sikring | Retshjælpsforsik- ring | Assistance | Diverse økonomiske tab |
| | | C0010 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Hjemland | R0041 | | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0050 | | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0060 | | | | | | |
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | | | | |
| Hjemland | R0070 | | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0080 | | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0090 | | | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | R0100 | | | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | R0110 | | | | | | |

| Geografisk zone/land | | | Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | |
|---|--------------|--------------|---|---------------------------------------|--|--|
| | | | Ikkeproportional sygegenforsikring | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | Ikkeproportional ejendomsgenforsikring |
| | | C0010 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| Direkte virksomhed | | | | | | |
| Hjemland | R0010 | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0020 | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0030 | | | | | |
| Accepteret proportional genforsikring | | | | | | |
| Hjemland | R0041 | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0050 | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0060 | | | | | |
| Accepteret ikkeproportional genforsikring | | | | | | |
| Hjemland | R0070 | | | | | |
| EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0080 | | | | | |
| Ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | R0090 | | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | R0100 | | | | | |
| Lande inden for væsentlighedstærsklen | R0110 | | | | | |

S.18.01.01

Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — skadesforsikring)

| | | Bedste skøn over præmiehensættelser (Brutto) | | | | Bedste skøn over erstatningshensættelser (Brutto) | | | | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
|--|-------|--|---|----------------------|----------------------------|---|---|----------------------|----------------------------|--|
| | | Likviditetstab | | Likviditetstilførsel | | Likviditetstab | | Likviditetstilførsel | | |
| | | Fremtidige ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | Fremtidige ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | | | | | |

| | | Bedste skøn over præmiehensættelser (Brutto) | | | | Bedste skøn over erstatningshensættelser (Brutto) | | | | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) |
|--------------|--------------|--|---|----------------------|----------------------------|---|---|----------------------|----------------------------|--|
| | | Likviditetstab | | Likviditetstilførsel | | Likviditetstab | | Likviditetstilførsel | | |
| | | Fremtidige ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | Fremtidige ydelser | Fremtidige omkostninger og andre likviditetstab | Fremtidige præmier | Anden likviditetstilførsel | |
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | |
| 24 | R0240 | | | | | | | | | |
| 25 | R0250 | | | | | | | | | |
| 26 | R0260 | | | | | | | | | |
| 27 | R0270 | | | | | | | | | |
| 28 | R0280 | | | | | | | | | |
| 29 | R0290 | | | | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | | | | | |
| 31 og senere | R0310 | | | | | | | | | |

| | |
|-------|----------------------------------|
| | Brancher, som er omfattet |
| | C1000 |
| R1000 | |

S.19.01.01

Skadesforsikringserstatninger

| | | |
|-------------------------|-------|--|
| Branche | Z0010 | |
| Ulykkesår/forsikringsår | Z0020 | |
| Valuta | Z0030 | |
| Valutaomregning | Z0040 | |

Udbetalte bruttoerstatninger (ikkekumulativt)

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | | I indeværende år C0170 | Sum af år (kumulativt) C0180 |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|---------------------------|------------------------------------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + | | |
| Tidligere | R0100 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0110 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0120 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0130 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0140 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0150 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0160 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0170 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0180 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0190 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0200 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0210 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0220 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0230 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0240 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0250 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| I alt | R0260 | | | | | | | | | | | | | | | | | |

Modtagne beløb i henhold til genforsikringsaftaler (ikkekumulativt)

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | R0300 | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| N-14 | R0310 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0320 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0330 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0340 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0350 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0360 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0370 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0380 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0390 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0400 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0410 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0420 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0430 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0440 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0450 | | | | | | | | | | | | | | | |

| I alt | I indeværende år | Sum af år (kumulativt) |
|-------|------------------|------------------------|
| | C0760 | C0770 |
| R0300 | | |
| R0310 | | |
| R0320 | | |
| R0330 | | |
| R0340 | | |
| R0350 | | |
| R0360 | | |
| R0370 | | |
| R0380 | | |
| R0390 | | |
| R0400 | | |
| R0410 | | |
| R0420 | | |
| R0430 | | |
| R0440 | | |
| R0450 | | |
| R0460 | | |

Udbetalte nettoerstatninger (ikkekumulativt)

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | R0500 | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| N-14 | R0510 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0520 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0530 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0540 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0550 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0560 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0570 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0580 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0590 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0600 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0610 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0620 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0630 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0640 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0650 | | | | | | | | | | | | | | | |

| I alt | I indeværende år | Sum af år (kumulativt) |
|-------|------------------|------------------------|
| | C1360 | C1370 |
| R0500 | | |
| R0510 | | |
| R0520 | | |
| R0530 | | |
| R0540 | | |
| R0550 | | |
| R0560 | | |
| R0570 | | |
| R0580 | | |
| R0590 | | |
| R0600 | | |
| R0610 | | |
| R0620 | | |
| R0630 | | |
| R0640 | | |
| R0650 | | |
| R0660 | | |

Bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, udiskonteret

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0100 | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| N-13 | R0110 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0120 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0130 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0140 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0150 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0160 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0170 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0180 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0190 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0200 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0210 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0220 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0230 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0240 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | R0250 | | | | | | | | | | | | | | | |

I alt

| Årets udgang (diskonterede data) | |
|----------------------------------|-------|
| | C0360 |
| R0100 | |
| R0110 | |
| R0120 | |
| R0130 | |
| R0140 | |
| R0150 | |
| R0160 | |
| R0170 | |
| R0180 | |
| R0190 | |
| R0200 | |
| R0210 | |
| R0220 | |
| R0230 | |
| R0240 | |
| R0250 | |
| R0260 | |

Udiskonterede bedste skøn over erstatningshensættelser — beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0300 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0310 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0320 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0330 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0340 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0350 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0360 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0370 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0380 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0390 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0400 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0410 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0420 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0430 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0440 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | R0450 | | | | | | | | | | | | | | | |

I alt

| Årets udgang (diskonterede data) | |
|-------------------------------------|-------|
| | C0960 |
| R0300 | |
| R0310 | |
| R0320 | |
| R0330 | |
| R0340 | |
| R0350 | |
| R0360 | |
| R0370 | |
| R0380 | |
| R0390 | |
| R0400 | |
| R0410 | |
| R0420 | |
| R0430 | |
| R0440 | |
| R0450 | |
| R0460 | |

Bedste skøn over erstatningshensættelser, netto, udiskonteret

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | C1400 | C1410 | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 | C1550 |
| N-14 | R0500 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0510 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0520 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0530 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0540 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0550 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0560 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0570 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0580 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0590 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0600 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0610 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0620 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0630 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0640 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | R0650 | | | | | | | | | | | | | | | |

I alt

| Årets udgang (diskonterede data) | |
|-------------------------------------|-------|
| | C1560 |
| R0500 | |
| R0510 | |
| R0520 | |
| R0530 | |
| R0540 | |
| R0550 | |
| R0560 | |
| R0570 | |
| R0580 | |
| R0590 | |
| R0600 | |
| R0610 | |
| R0620 | |
| R0630 | |
| R0640 | |
| R0650 | |
| R0660 | |

Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto — trekant

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | R0100 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0110 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0120 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0130 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0140 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0150 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0160 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0170 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0180 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0190 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0200 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0210 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0220 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0230 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0240 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0250 | | | | | | | | | | | | | | | |

| Ved årets udgang | |
|------------------|-------|
| R0100 | C0560 |
| R0110 | |
| R0120 | |
| R0130 | |
| R0140 | |
| R0150 | |
| R0160 | |
| R0170 | |
| R0180 | |
| R0190 | |
| R0200 | |
| R0210 | |
| R0220 | |
| R0230 | |
| R0240 | |
| R0250 | |
| I alt | R0260 |

Anmeldte, men ikke afregnede krav, genforsikring

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | R0300 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0310 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0320 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0330 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0340 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0350 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0360 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0370 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0380 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0390 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0400 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0410 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0420 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0430 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0440 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0450 | | | | | | | | | | | | | | | |

| I alt | Ved årets udgang | |
|-------|------------------|-------|
| | | C1160 |
| | R0300 | |
| | R0310 | |
| | R0320 | |
| | R0330 | |
| | R0340 | |
| | R0350 | |
| | R0360 | |
| | R0370 | |
| | R0380 | |
| | R0390 | |
| | R0400 | |
| | R0410 | |
| | R0420 | |
| | R0430 | |
| | R0440 | |
| | R0450 | |
| | R0460 | |

Anmeldte, men ikke afregnede krav, netto

(absolut beløb)

| År | Udviklingsår | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|----|----|----|----|--------|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 & + |
| Tidligere | R0500 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0510 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0520 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0530 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0540 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0550 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0560 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0570 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0580 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-6 | R0590 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-5 | R0600 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-4 | R0610 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-3 | R0620 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-2 | R0630 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N-1 | R0640 | | | | | | | | | | | | | | | |
| N | R0650 | | | | | | | | | | | | | | | |

| I alt | Ved årets udgang | |
|-------|------------------|-------|
| | | C1760 |
| | R0500 | |
| | R0510 | |
| | R0520 | |
| | R0530 | |
| | R0540 | |
| | R0550 | |
| | R0560 | |
| | R0570 | |
| | R0580 | |
| | R0590 | |
| | R0600 | |
| | R0610 | |
| | R0620 | |
| | R0630 | |
| | R0640 | |
| | R0650 | |
| | R0660 | |

Inflationsrater (kun hvis der anvendes metoder, der tager højde for inflationen for at korrigere dataene)

| | | N-14 | N-13 | N-12 | N-11 | N-10 | N-9 | N-8 | N-7 | N-6 | N-5 | N-4 | N-3 | N-2 | N-1 | N |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | C1800 | C1810 | C1820 | C1830 | C1840 | C1850 | C1860 | C1870 | C1880 | C1890 | C1900 | C1910 | C1920 | C1930 | C1940 |
| Historisk inflationsrate — i alt | R0700 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Historisk inflationsrate: ekstern inflation | R0710 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Historisk inflationsrate: endogen inflation | R0720 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | C2000 | C2010 | C2020 | C2030 | C2040 | C2050 | C2060 | C2070 | C2080 | C2090 | C2100 | C2110 | C2120 | C2130 | C2140 |
| | | N+1 | N+2 | N+3 | N+4 | N+5 | N+6 | N+7 | N+8 | N+9 | N+10 | N+11 | N+12 | N+13 | N+14 | N+15 |
| Forventet inflationsrate — i alt | R0730 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Forventet inflationsrate: ekstern inflation | R0740 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Forventet inflationsrate: endogen inflation | R0750 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | C2200 | | | | | | | | | | | | | | |
| Beskrivelse af den anvendte inflationsrate: | R0760 | | | | | | | | | | | | | | | |

S.20.01.01

Udvikling i fordelingen af erstatningsudgifter

| | | |
|-------------------------|-------|--|
| Branche | Z0010 | |
| Ulykkesår/forsikringsår | Z0020 | |

Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto

| | | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse | | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|--|----------------------------|---|-----------------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|--|
| | | Udestående krav ved årets udgang | | | | Afsluttede krav ved årets udgang: | | | | |
| | | | | | | Afregnet med betaling | | | Afregnet uden betaling | |
| | | Antal krav | Anmeldte, men ikke afregnede krav ved årets begyndelse, brutto | Bruttobetaling i årets løb | Anmeldte, men ikke afregnede krav ved periodens udløb, brutto | Antal krav afsluttet med betaling | Anmeldte, men ikke afregnede krav ved årets begyndelse, brutto | Bruttobetaling i årets løb | Antal krav afsluttet uden betaling | Anmeldte, men ikke afregnede krav ved årets begyndelse, brutto, afregnet uden betaling |
| År | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| Tidligere | R0010 | | | | | | | | | |
| N-14 | R0020 | | | | | | | | | |
| N-13 | R0030 | | | | | | | | | |
| N-12 | R0040 | | | | | | | | | |
| N-11 | R0050 | | | | | | | | | |
| N-10 | R0060 | | | | | | | | | |
| N-9 | R0070 | | | | | | | | | |

Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto

| År | | Krav anmeldt i årets løb | | | | | | Krav genåbnet i årets løb | | | | |
|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|-------|-------|-----------------------------------|-------|
| | | Udestående krav ved årets udgang | | | Afsluttede krav ved årets udgang: | | | Udestående krav ved årets udgang | | | Afsluttede krav ved årets udgang: | |
| | | Antal krav | Bruttobetaling i årets løb | Anmeldte, men ikke afregnede krav ved periodens udløb, brutto | Antal krav afsluttet med betaling | Bruttobetaling i årets løb | Antal krav afsluttet uden betaling | | | | | |
| C0110 | C0120 | | | | | | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| Tidligere | R0010 | | | | | | | | | | | |
| N-14 | R0020 | | | | | | | | | | | |
| N-13 | R0030 | | | | | | | | | | | |
| N-12 | R0040 | | | | | | | | | | | |
| N-11 | R0050 | | | | | | | | | | | |
| N-10 | R0060 | | | | | | | | | | | |
| N-9 | R0070 | | | | | | | | | | | |
| N-8 | R0080 | | | | | | | | | | | |
| N-7 | R0090 | | | | | | | | | | | |

S.21.01.01

Risikoprofil for fordeling af tab

| | | |
|-------------------------|--------------|--|
| Branche | Z0010 | |
| Ulykkesår/forsikringsår | Z0020 | |

| | | Start — Erstatningsudgifter | Slut — Erstatningsudgifter | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-1 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-1 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-2 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-2 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-3 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-3 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-4 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-4 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-5 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-5 |
|------------|--------------|-----------------------------|----------------------------|--------------------------------------|---|--|---|--|---|--|---|--|---|--|---|
| | | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 |
| Interval 1 | R0010 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 2 | R0020 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 3 | R0030 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 4 | R0040 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 5 | R0050 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 6 | R0060 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 7 | R0070 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 8 | R0080 | | | | | | | | | | | | | | |
| Interval 9 | R0090 | | | | | | | | | | | | | | |

| | | Start — Erstatningsudgifter | Slut — Erstatningsudgifter | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-12 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-12 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-13 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-13 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N-14 | Erstatningsudgifter i alt — ulykkesår/forsikringsår N-14 |
|--------------|--------------|-----------------------------|----------------------------|---|--|---|--|---|--|
| | | C0030 | C0040 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 |
| Interval 6 | R0060 | | | | | | | | |
| Interval 7 | R0070 | | | | | | | | |
| Interval 8 | R0080 | | | | | | | | |
| Interval 9 | R0090 | | | | | | | | |
| Interval 10 | R0100 | | | | | | | | |
| Interval 11 | R0110 | | | | | | | | |
| Interval 12 | R0120 | | | | | | | | |
| Interval 13 | R0130 | | | | | | | | |
| Interval 14 | R0140 | | | | | | | | |
| Interval 15 | R0150 | | | | | | | | |
| Interval 16 | R0160 | | | | | | | | |
| Interval 17 | R0170 | | | | | | | | |
| Interval 18 | R0180 | | | | | | | | |
| Interval 19 | R0190 | | | | | | | | |
| Interval 20 | R0200 | | | | | | | | |
| Interval 21 | R0210 | | | | | | | | |
| I alt | R0300 | | | | | | | | |

S.21.02.01

Skadesforsikringsrisici

| Risikoidentifikationskode | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | Risikobeskrivelse | Branche | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Gyldighedsperiode (startdato) | Gyldighedsperiode (slutdato) | Valuta | Forsikringssum | Forsikringstagerens oprindelige selvrisiko | Type forsikringsmodel |
|---------------------------|---|-------------------|---------|---|-------------------------------|------------------------------|--------|----------------|--|-----------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Beløb i henhold til forsikringsmodel | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring med alle genforsikringselskaber | Beløb dækket ved genforsikring hos alle genforsikringselskaber, ikke fakultativ | Forsikringselskabets nettotilbageholdelse |
|--------------------------------------|---|---|---|
| C0120 | C0130 | C0140 | C0150 |
| | | | |

S.21.03.01

Fordeling af skadesforsikringsrisici — Efter forsikringssum

| Branche | | Z0010 | | | | |
|------------|-------|------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------------------|
| Interval | R | Start — Forsikringssum | Slut — forsikringssum | Antal forsikringsrisici | Forsikringssum i alt | Årlige tegnede præmier i alt |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Interval 1 | R0010 | | | | | |
| Interval 2 | R0020 | | | | | |
| Interval 3 | R0030 | | | | | |
| Interval 4 | R0040 | | | | | |
| Interval 5 | R0050 | | | | | |

| | | Start — Forsikrings- sum | Slut — forsikringssum | Antal forsikringsrisici | Forsikringssum i alt | Årlige tegnede præmier i alt |
|--------------|--------------|-----------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|---------------------------------|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Interval 6 | R0060 | | | | | |
| Interval 7 | R0070 | | | | | |
| Interval 8 | R0080 | | | | | |
| Interval 9 | R0090 | | | | | |
| Interval 10 | R0100 | | | | | |
| Interval 11 | R0110 | | | | | |
| Interval 12 | R0120 | | | | | |
| Interval 13 | R0130 | | | | | |
| Interval 14 | R0140 | | | | | |
| Interval 15 | R0150 | | | | | |
| Interval 16 | R0160 | | | | | |
| Interval 17 | R0170 | | | | | |
| Interval 18 | R0180 | | | | | |
| Interval 19 | R0190 | | | | | |
| Interval 20 | R0200 | | | | | |
| Interval 21 | R0210 | | | | | |
| I alt | R0220 | | | | | |

S.22.01.01

Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger

| | | Virkning af de langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger (trinvis metode) | | | | | | | | | |
|---|--------------|--|---|--|---|--|--|---|--|---|---|
| | | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul | Uden matchtilpasning og uden alle de andre | Virkning af matchtilpasning sat til nul | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger |
| | | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Forsikringsmæssige hensættelser | R0010 | | | | | | | | | | |
| Basiskapitalgrundlag | R0020 | | | | | | | | | | |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver | R0030 | | | | | | | | | | |
| Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | R0040 | | | | | | | | | | |
| Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | R0050 | | | | | | | | | | |
| Kernekapital | R0060 | | | | | | | | | | |
| Supplerende kapital | R0070 | | | | | | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0080 | | | | | | | | | | |
| Solvenskapitalkrav | R0090 | | | | | | | | | | |
| Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | R0100 | | | | | | | | | | |
| Minimumskapitalkrav | R0110 | | | | | | | | | | |
| Solvenskapitalkravsprocent | R0120 | | | | | | | | | | |
| Minimumskapitalkravsprocent | R0130 | | | | | | | | | | |

S.22.01.04

Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger

| | | Virkning af de langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger (trinvis metode) | | | | | | | | | |
|---|--------------|--|---|--|---|--|--|---|--|---|---|
| | | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul | Uden matchtilpasning og uden alle de andre | Virkning af matchtilpasning sat til nul | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger |
| | | | | | | | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelser | R0010 | | | | | | | | | | |
| Basiskapitalgrundlag | R0020 | | | | | | | | | | |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver | R0030 | | | | | | | | | | |
| Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | R0040 | | | | | | | | | | |
| Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | R0050 | | | | | | | | | | |
| Kernekapital | R0060 | | | | | | | | | | |
| Supplerende kapital | R0070 | | | | | | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0080 | | | | | | | | | | |
| Solvenskapitalkrav | R0090 | | | | | | | | | | |
| Solvenskapitalkravsprocent | R0120 | | | | | | | | | | |
| Minimumskapitalkravsprocent | R0130 | | | | | | | | | | |

SR.22.02.01

Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Matchningsporteføljer)

| | | |
|----------------------|-------|--|
| Matchningsportefølje | Z0010 | |
|----------------------|-------|--|

| | | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden | | | Misforhold i løbet af indberetningsperioden | |
|--|-------|--|---|--|---|---|
| | | Likviditetstab i forbindelse med levetids-, dødeligheds- og optionsforpligtelser | Likviditetstab i forbindelse med udgifter | Risikoreducerede cash flow for aktiver | Positivt udiskonteret misforhold (indgående strømme > udgående strømme) | Negativt udiskonteret misforhold (indgående strømme < udgående strømme) |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | |
| 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 | | | | | |

| | | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden | | | Misforhold i løbet af indberetningsperioden | |
|--|--------------|--|---|--|---|---|
| | | Likviditetstab i forbindelse med levetids-, dødeligheds- og optionsforpligtelser | Likviditetstab i forbindelse med udgifter | Risikoreducerede cash flow for aktiver | Positivt udiskonteret misforhold (indgående strømme > udgående strømme) | Negativt udiskonteret misforhold (indgående strømme < udgående strømme) |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | |
| 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 | | | | | |

| | | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden | | | Misforhold i løbet af indberetningsperioden | |
|--|--------------|--|---|--|---|---|
| | | Likviditetstab i forbindelse med levetids-, dødeligheds- og optionsforpligtelser | Likviditetstab i forbindelse med udgifter | Risikoreducerede cash flow for aktiver | Positivt udiskonteret misforhold (indgående strømme > udgående strømme) | Negativt udiskonteret misforhold (indgående strømme < udgående strømme) |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| År (fremskrivning af udiskonterede forventede cash flow) | | | | | | |
| 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 og senere | R0450 | | | | | |

SR.22.03.01

Oplysninger om beregning af matchtilpasning

| | | |
|----------------------|-------|--|
| Matchningsportefølje | Z0010 | |
|----------------------|-------|--|

| | | C0010 |
|---|--------------|-------|
| Overordnet beregning af matchtilpasningen | | |
| Årlig effektiv rente anvendt på cash flowet for forpligtelserne | R0010 | |
| Årlig effektiv rente svarende til bedste skøn | R0020 | |
| Sandsynlighed for misligholdelse anvendt til at risikoreducere cash flow vedrørende aktiver | R0030 | |
| Del af det grundlæggende kreditspænd, der ikke afspejles ved risikoreduktion af cash flow for aktiver | R0040 | |
| Stigning i det grundlæggende kreditspænd for aktiver, der er sub-investment grade | R0050 | |
| Matchtilpasning af den risikofrie rente | R0060 | |
| Solvenskapitalkrav | | |
| Dødelighedsrisicistress med henblik på matchtilpasning | R0070 | |
| Portefølje | | |
| Markedsværdi af aktiver i porteføljen | R0080 | |
| Inflationsafhængig markedsværdi af aktiver | R0090 | |
| Inflationsafhængigt bedste skøn | R0100 | |
| Markedsværdi af aktiver, hvor tredjemand kan ændre cash flow | R0110 | |
| Afkast af aktiver — porteføljeaktiver | R0120 | |

| | | C0010 |
|--|-------|-------|
| Markedsværdi af genkøbte aftaler | R0130 | |
| Antal genkøbsoptioner, der er udnyttet | R0140 | |
| Markedsværdi af aktiver i tilknytning til genkøbte aftaler | R0150 | |
| Beløb udbetalt til forsikringstagere | R0160 | |
| Forpligtelser | | X |
| Varighed | R0170 | |

S.22.04.01**Overgangsforanstaltninger for beregning af rentesatser****Overordnet beregning af overgangsjusteringen**

| Valuta | Z0010 | |
|--|-------|--|
| | | Justering af den risikofrie rente |
| | | C0010 |
| Solvens I-rente | R0010 | |
| Årlig effektiv rente | R0020 | |
| Andel af forskellen anvendt på indberetningsdatoen | R0030 | |
| Justering af den risikofrie rente | R0040 | |

Solvens I-rente

| | | |
|---------------|--------------|--|
| Valuta | Z0010 | |
|---------------|--------------|--|

| | | Bedste skøn | Gennemsnitlig varighed af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser |
|----------------------------|--------------|--------------------|--|
| | | C0020 | C0030 |
| Op til 0,5 % | R0100 | | |
| Over 0,5 % og op til 1,0 % | R0110 | | |
| Over 1,0 % og op til 1,5 % | R0120 | | |
| Over 1,5 % og op til 2,0 % | R0130 | | |
| Over 2,0 % og op til 2,5 % | R0140 | | |
| Over 2,5 % og op til 3,0 % | R0150 | | |
| Over 3,0 % og op til 4,0 % | R0160 | | |
| Over 4,0 % og op til 5,0 % | R0170 | | |
| Over 5,0 % og op til 6,0 % | R0180 | | |
| Over 6,0 % og op til 7,0 % | R0190 | | |
| Over 7,0 % og op til 8,0 % | R0200 | | |
| Over 8,0 % | R0210 | | |

S.22.05.01

Overordnet beregning af overgangsforanstaltningerne for forsikringsmæssige hensættelser

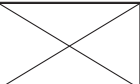
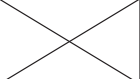
| | | C0010 |
|---|--------------|-------|
| Forsikringsmæssige hensættelser efter Solvens II — dag 1 | R0010 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | | X |
| Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | R0020 | |
| Bedste skøn | R0030 | |
| Risikomargin | R0040 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser efter Solvens I | R0050 | |
| Del af den justerede forskel | R0060 | |
| Anvendt begrænsning i henhold til artikel 308d, stk. 4 | R0070 | |
| Forsikringsmæssige hensættelser efter overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | R0080 | |

S.22.06.01

Bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering efter land og valuta

| | | |
|--------------------------------------|-------|-----|
| Branche | Z0010 | |
| Anden valuta end indberetningsvaluta | R0010 | ... |

Bedste skøn omfattet af lande- og valutavolatilitetsjustering — I alt og pr. hjemland efter valuta

| | | | Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering (for alle valutaer) | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i indberetningsvalutaen | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i valutaer | |
|--|-------|--|---|---|--|-----|
| | | | C0030 | C0040 | C0050 | ... |
| Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering i alle lande | R0020 |  | | | | |
| Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering i hjemlandet | R0030 |  | | | | |

Bedste skøn omfattet af lande- og valutavolatilitetsjustering — Efter land og valuta

| | | Lande | Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering (for alle valutaer) | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i indberetningsvalutaen | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i valutaer | |
|--|-------|-------|---|---|--|-----|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | ... |
| Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering i andre lande end hjemlandet | R0040 | | | | | |
| ... | | | | | | |

S.23.01.01

Kapitalgrundlag

Basiskapitalgrundlag før fradrag af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer som omhandlet i artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35

Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier)

Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital

Beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber

Efterstillede gensidige medlemskonti

Overskudskapital

Præferenceaktier

Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier

Afstemningsreserve

Efterstillet gæld

Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto

Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| | | | | |
| R0010 | | | | |
| R0030 | | | | |
| R0040 | | | | |
| R0050 | | | | |
| R0070 | | | | |
| R0090 | | | | |
| R0110 | | | | |
| R0130 | | | | |
| R0140 | | | | |
| R0160 | | | | |
| R0180 | | | | |
| | | | | |
| R0220 | | | | |

Fradrag

Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter

Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag**Supplerende kapitalgrundlag**

Ubetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt

Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt

Ubetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt

En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning

Remburser og garantier henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF

Remburser og garantier ikke henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF

Indkaldelse af supplerende bidrag hos medlemmer henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF

Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF

Andre former for supplerende kapitalgrundlag

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|--------------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| | | | | |
| R0230 | | | | |
| R0290 | | | | |
| | | | | |
| R0300 | | | | |
| | | | | |
| R0310 | | | | |
| | | | | |
| R0320 | | | | |
| | | | | |
| R0330 | | | | |
| | | | | |
| R0340 | | | | |
| | | | | |
| R0350 | | | | |
| | | | | |
| R0360 | | | | |
| | | | | |
| R0370 | | | | |
| | | | | |
| R0390 | | | | |

Samlet supplerende kapitalgrundlag

Til rådighed stående og anerkendt kapitalgrundlag

Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet

Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet

Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet

Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet

Solvenskapitalkrav

MCR

Forhold mellem anerkendt kapitalgrundlag og solvenskapitalkrav

Forhold mellem anerkendt kapitalgrundlag og minimumskapitalkrav

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0400 | | | | |
| | | | | |
| R0500 | | | | |
| R0510 | | | | |
| R0540 | | | | |
| R0550 | | | | |
| R0580 | | | | |
| R0600 | | | | |
| R0620 | | | | |
| R0640 | | | | |

Afstemningsreserve

Overskydende aktiver i forhold til passiver

Egne aktier (som besiddes direkte og indirekte)

Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer

Andre basiskapitalgrundlagselementer

Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde

Afstemningsreserve**Forventet fortjeneste**

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — livsforsikring

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — skadesforsikring

Samlet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier

| C0060 | |
|--------------|--|
| | |
| R0700 | |
| R0710 | |
| R0720 | |
| R0730 | |
| R0740 | |
| R0760 | |
| R0770 | |
| R0780 | |
| R0790 | |

S.23.01.04

Kapitalgrundlag

Basiskapitalgrundlag før fradrag

Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier)

Ikke til rådighed stående, indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, der skal fratrækkes på koncernniveau

Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital

Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglikende selskaber

Efterstillede gensidige medlemskonti

Ikke til rådighed stående, efterstillede gensidige medlemskonti, der skal fratrækkes på koncernniveau

Overskudskapital

Ikke til rådighed stående overskudskapital, der skal fratrækkes på koncernniveau

Præferenceaktier

Ikke til rådighed stående præferenceaktier, der skal fratrækkes på koncernniveau

Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier

Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som skal fratrækkes på koncernniveau

Afstemningsreserve

Efterstillet gæld

Ikke til rådighed stående efterstillet gæld, der skal fratrækkes på koncernniveau

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| | | | | |
| R0010 | | | | |
| R0020 | | | | |
| R0030 | | | | |
| R0040 | | | | |
| R0050 | | | | |
| R0060 | | | | |
| R0070 | | | | |
| R0080 | | | | |
| R0090 | | | | |
| R0100 | | | | |
| R0110 | | | | |
| R0120 | | | | |
| R0130 | | | | |
| R0140 | | | | |
| R0150 | | | | |

Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto

Beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver, der skal fratrækkes på koncernniveau, netto

Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden

Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer, som skal fratrækkes, godkendt af tilsynsmyndigheden

Minoritetsinteresser

Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

Fradrag

Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter

Heraf fratrukket i henhold til artikel 228 i direktiv 2009/138/EF

Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229)

Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder

Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes

Sum af fradrag

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0160 | | | | |
| R0170 | | | | |
| R0180 | | | | |
| R0190 | | | | |
| R0200 | | | | |
| R0210 | | | | |
| R0220 | | | | |
| R0230 | | | | |
| R0240 | | | | |
| R0250 | | | | |
| R0260 | | | | |
| R0270 | | | | |
| R0280 | | | | |

Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag**Supplerende kapitalgrundlag**

Ubetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt

Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt

Ubetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt

En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning

Remburser og garantier henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF

Remburser og garantier ikke henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF

Indkaldelse af supplerende bidrag hos medlemmer henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF

Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF

Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag, der skal fratrækkes på koncernniveau

Andre former for supplerende kapitalgrundlag

Samlet supplerende kapitalgrundlag**Kapitalgrundlag i andre finansielle sektorer**

Kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, finansielle institutioner

Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser

Ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0290 | | | | |
| | | | | |
| R0300 | | | | |
| | | | | |
| R0310 | | | | |
| | | | | |
| R0320 | | | | |
| | | | | |
| R0330 | | | | |
| | | | | |
| R0340 | | | | |
| | | | | |
| R0350 | | | | |
| | | | | |
| R0360 | | | | |
| | | | | |
| R0370 | | | | |
| | | | | |
| R0380 | | | | |
| | | | | |
| R0390 | | | | |
| | | | | |
| R0400 | | | | |
| | | | | |
| R0410 | | | | |
| | | | | |
| R0420 | | | | |
| | | | | |
| R0430 | | | | |
| | | | | |

Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer

Kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering anvendes, alene eller i kombination med metode 1

Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes

Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes, med fradrag af koncerninterne transaktioner

Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering)

Til rådighed stående kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau

Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau

Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering)

Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering)

Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering)

Den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalkravet fra andre finansielle sektorer og solvenskapitalkravet for selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Konsolideret minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0440 | | | | |
| | | | | |
| R0450 | | | | |
| R0460 | | | | |
| R0520 | | | | |
| R0530 | | | | |
| R0560 | | | | |
| R0570 | | | | |
| R0800 | | | | |
| R0810 | | | | |
| R0660 | | | | |
| R0820 | | | | |
| R0610 | | | | |

Kapitalkrav fra andre finansielle sektorer

Det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, eksklusivt solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusivt kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, inklusive solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0560) og den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau (R0820), men eksklusivt andre finansielle sektorer og selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0860 | | | | |
| R0590 | | | | |
| R0670 | | | | |
| R0830 | | | | |
| R0680 | | | | |
| R0630 | | | | |

Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0570) og det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau (R0610).

Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0800) og det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (R590), inklusive andre finansielle sektorer, men eksklusivt selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0810) og koncernens solvenskapitalkrav (R0830), eksklusivt andre finansielle sektorer, men inklusive selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0660) i alt og koncernens samlede solvenskapitalkrav (R0680), men inklusive andre finansielle sektorer og selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering

| I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital |
|-------|---------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| R0650 | | | | |
| R0840 | | | | |
| R0850 | | | | |
| R0690 | | | | |

Afstemningsreserve

Overskydende aktiver i forhold til passiver

Egne aktier (som besiddes direkte og indirekte)

Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer

Andre basiskapitalgrundlagselementer

Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde

Andet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag

Afstemningsreserve

Forventet fortjeneste

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — livsforsikring

Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — skadesforsikring

Samlet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier

| C0060 | |
|--------------|--|
| | |
| R0700 | |
| R0710 | |
| R0720 | |
| R0730 | |
| R0740 | |
| R0750 | |
| R0760 | |
| R0770 | |
| R0780 | |
| R0790 | |

S.23.02.01

Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag, opdelt efter kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital (tiers)

| | I alt | Kernekapital | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital |
|--|-------|--------------------|---|---------------------------|---|--------------------------------|
| | | Kernekapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | Supplerende kapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | |
| | | | | | | |
| Stamaktiekapital | | | | | | |
| Indbetalt | R0010 | | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0020 | | | | | |
| Egne aktier, som besiddes | R0030 | | | | | |
| Samlet stamaktiekapital | R0100 | | | | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basis-kapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | | | | | | |
| Indbetalt | R0110 | | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0120 | | | | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basis-kapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | R0200 | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti | | | | | | |
| Dateret efterstillet | R0210 | | | | | |
| Udateret efterstillet med en call-option | R0220 | | | | | |
| Udateret efterstillet uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0230 | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | R0300 | | | | | |
| Præferenceaktier | | | | | | |
| Daterede præferenceaktier | R0310 | | | | | |

| | I alt | Kernekapital | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital |
|--|-------|--------------------|---|---------------------------|---|--------------------------------|
| | | Kernekapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | Supplerende kapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | |
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Udaterede præferenceaktier med en call-option | R0320 | | | | | |
| Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0330 | | | | | |
| Præferenceaktier i alt | R0400 | | | | | |
| Efterstillet gæld | | | | | | |
| Daterede efterstillede forpligtelser | R0410 | | | | | |
| Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0420 | | | | | |
| Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0430 | | | | | |
| Efterstillede forpligtelser i alt | R0500 | | | | | |

| | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital | |
|---|-------|-----------------------------|----------------|--------------------------------|----------------|
| | | Godkendte oprindelige beløb | Aktuelle beløb | Godkendte oprindelige beløb | Aktuelle beløb |
| | | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| Supplerende kapitalgrundlag | | | | | |
| Elementer, for hvilke et beløb er godkendt | R0510 | | | | |
| Elementer, for hvilke en metode er godkendt | R0520 | | | | |

S.23.02.04

Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag, opdelt efter kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital (tiers)

| | I alt | Kernekapital | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital |
|--|-------|--------------------|---|---------------------|---|--------------------------------|
| | | Kernekapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | Supplerende kapital | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | |
| | | | | | | |
| Stamaktiekapital | | | | | | |
| Indbetalt | R0010 | | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0020 | | | | | |
| Egne aktier, som besiddes | R0030 | | | | | |
| Samlet stamaktiekapital | R0100 | | | | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basis-kapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | | | | | | |
| Indbetalt | R0110 | | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0120 | | | | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basis-kapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | R0200 | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti | | | | | | |
| Dateret efterstillet | R0210 | | | | | |
| Udateret efterstillet med en call-option | R0220 | | | | | |
| Udateret efterstillet uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0230 | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | R0300 | | | | | |
| Præferenceaktier | | | | | | |
| Daterede præferenceaktier | R0310 | | | | | |

| | I alt | Kernekapital | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital |
|--|-------|--------------------|---|---------------------|---|--------------------------------|
| | | Kernekapital i alt | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | Supplerende kapital | Heraf omfattet af overgangsbestemmelser | |
| | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Udaterede præferenceaktier med en call-option | R0320 | | | | | |
| Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0330 | | | | | |
| Præferenceaktier i alt | R0400 | | | | | |
| Efterstillet gæld | | | | | | |
| Daterede efterstillede forpligtelser | R0410 | | | | | |
| Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0420 | | | | | |
| Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten | R0430 | | | | | |
| Efterstillede forpligtelser i alt | R0500 | | | | | |

| | | Supplerende kapital | | Resterende supplerende kapital | |
|---|-------|-----------------------------|----------------|--------------------------------|----------------|
| | | Godkendte oprindelige beløb | Aktuelle beløb | Godkendte oprindelige beløb | Aktuelle beløb |
| | | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| Supplerende kapitalgrundlag | | | | | |
| Elementer, for hvilke et beløb er godkendt | R0510 | | | | |
| Elementer, for hvilke en metode er godkendt | R0520 | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse | Lovgivnings- mæssige tiltag | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|---------|---------|------------------------------|--------------------------------|--|
| | | C0010 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0060 |
| Efterstillede gensidige medlemskonti — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | | | |
| Kernekapital | R0310 | | | | | | |
| Supplerende kapital | R0320 | | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0330 | | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | R0400 | | | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Balance overført til næste periode |
|-------------------------|--------------|---|--|
| | | C0010 | C0060 |
| Overskudskapital | R0500 | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Stigning | Fald | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|----------|-------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0060 |
| Præferenceaktier — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Kernekapital | R0510 | | | | |
| Supplerende kapital | R0520 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0530 | | | | |
| Præferenceaktier i alt | R0600 | | | | |
| Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier | | | | | |
| Kernekapital | R0610 | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Stigning | Fald | | Balance overført til næste periode |
|--------------------------------|--------------|---|----------|-------|--|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | | C0060 |
| Supplerende kapital | R0620 | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0630 | | | | | |
| I alt | R0700 | | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse | Lovgivnings- mæssige tiltag | Balance overført til næste periode |
|---|--------------|---|---------|---------|------------------------------|--------------------------------|--|
| | | C0010 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0060 |
| Efterstillet gæld — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | | | |
| Kernekapital | R0710 | | | | | | |
| Supplerende kapital | R0720 | | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0730 | | | | | | |
| Efterstillede forpligtelser i alt | R0800 | | | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|--|--|
| | | C0010 | | C0060 |
| Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto | R0900 | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse |
|---|--------------|---|---------|---------|------------------------------|
| | | C0010 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Kernekapital, der skal behandles som ubegrænset | R1000 | | | | |
| Kernekapital, der skal behandles som begrænset | R1010 | | | | |
| Supplerende kapital | R1020 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R1030 | | | | |
| Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | R1100 | | | | |

| Balance overført til næste periode |
|--|
| C0060 |
| |
| |
| |
| |

| | | Balance overført fra foregående periode | Nyt beløb stillet til rådighed | Fald i til rådighed stående beløb | Indkaldt som basiskapital- grundlag |
|---|--------------|---|-----------------------------------|---|---|
| | | C0010 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Supplerende kapitalgrundlag — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Supplerende kapital | R1110 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R1120 | | | | |
| Samlet supplerende kapitalgrundlag | R1200 | | | | |

| Balance overført til næste periode |
|--|
| C0060 |
| |
| |
| |

S.23.03.04

Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget

| | | Balance overført fra foregående periode | Stigning | Fald | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|----------|-------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0060 |
| Stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Indbetalt | R0010 | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0020 | | | | |
| Egne aktier, som besiddes | R0030 | | | | |
| Samlet stamaktiekapital | R0100 | | | | |
| Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Kernekapital | R0110 | | | | |
| Supplerende kapital | R0120 | | | | |
| I alt | R0200 | | | | |
| Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basis-kapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglig-nende selskaber — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Indbetalt | R0210 | | | | |
| Indkaldt, men endnu ikke indbetalt | R0220 | | | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensi-dige og gensidiglig-nende selskaber | R0300 | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse | Lovgivnings- mæssige tiltag | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|---------|---------|------------------------------|--------------------------------|--|
| | | C0010 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0060 |
| Efterstillede gensidige medlemskonti — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | | | |
| Kernekapital | R0310 | | | | | | |
| Supplerende kapital | R0320 | | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0330 | | | | | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | R0400 | | | | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | | Balance overført til næste periode |
|-------------------------|--------------|---|--|--|
| | | C0010 | | C0060 |
| Overskudskapital | R0500 | | | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Stigning | Fald | Balance overført til næste periode |
|--|--------------|---|----------|-------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | |
| Præferenceaktier — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Kernekapital | R0510 | | | | |
| Supplerende kapital | R0520 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0530 | | | | |
| Præferenceaktier i alt | R0600 | | | | |
| Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier | | | | | |
| Kernekapital | R0610 | | | | |

| Balance overført fra foregående periode | Stigning | Fald | Balance overført til næste periode |
|---|----------|-------|--|
| C0010 | C0020 | C0030 | |

| | | | | |
|--------------------------------|--------------|--|--|--|
| Supplerende kapital | R0620 | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0630 | | | |
| I alt | R0700 | | | |

| Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse | Lovgivnings- mæssige tiltag | Balance overført til næste periode |
|---|---------|---------|------------------------------|--------------------------------|--|
| C0010 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0060 |

| | | | | | | |
|---|--------------|--|--|--|--|--|
| Efterstillet gæld — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | | |
| Kernekapital | R0710 | | | | | |
| Supplerende kapital | R0720 | | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R0730 | | | | | |
| Efterstillede forpligtelser i alt | R0800 | | | | | |

| Balance overført fra foregående periode | Balance overført til næste periode |
|---|--|
| C0010 | C0060 |
| Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto R0900 | |

| | | Balance overført fra foregående periode | Udstedt | Indløst | Udsving i værdiansættelse |
|---|--------------|---|---------|---------|------------------------------|
| | | C0010 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Kernekapital, der skal behandles som ubegrænset | R1000 | | | | |
| Kernekapital, der skal behandles som begrænset | R1010 | | | | |
| Supplerende kapital | R1020 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R1030 | | | | |
| Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | R1100 | | | | |

| Balance overført til næste periode |
|--|
| C0060 |
| |
| |
| |
| |

| | | Balance overført fra foregående periode | Nyt beløb stillet til rådighed | Fald i til rådighed stående beløb | Indkaldt som basiskapital- grundlag |
|---|--------------|---|-----------------------------------|---|---|
| | | C0010 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Supplerende kapitalgrundlag — Bevægelser i indberetningsperioden | | | | | |
| Supplerende kapital | R1110 | | | | |
| Resterende supplerende kapital | R1120 | | | | |
| Samlet supplerende kapitalgrundlag | R1200 | | | | |

| Balance overført til næste periode |
|--|
| C0060 |
| |
| |
| |

S.23.04.01

Liste over kapitalgrundlagselementer

| Beskrivelse af efterstillede gensidige medlemskonti | Beløb | Kategori | Valutakode | Omfattet af overgangsbestemmelser? | Modpart (hvis specifik) | Udstedelses- dato (forts.) |
|---|-------|----------|------------|------------------------------------|-------------------------|----------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0070 | C0080 | C0090 |
| | | | | | | |

| Udløbsdato | Dato for første indløsning | Oplysninger om senere indløsningsdatoer | Oplysninger om incitament til at indløse | Varselsperiode | Tilbagekøb i årets løb |
|------------|----------------------------|---|--|----------------|------------------------|
| C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0160 |
| | | | | | |

| Beskrivelse af præferenceaktier | Beløb | Omfattet af overgangsbestemmelser? | Modpart (hvis specifik) | Udstedelses- dato | Dato for første indløsning | Oplysninger om senere indløsningsdatoer | Oplysninger om incitament til at indløse |
|---------------------------------|-------|------------------------------------|-------------------------|-------------------|----------------------------|---|--|
| C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| | | | | | | | |

| Beskrivelse af efterstillet gæld | Beløb | Kategori | Valutakode | Långiver (hvis specifik) | Omfattet af overgangsbestemmelser? | Udstedelses- dato (forts.) |
|----------------------------------|-------|----------|------------|--------------------------|------------------------------------|----------------------------|
| C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0320 | C0330 | C0350 |
| | | | | | | |

| Udløbsdato | Dato for første indløsning | Yderligere indløsningsdatoer | Oplysninger om incitament til at indløse | Varselsperiode |
|------------|----------------------------|------------------------------|--|----------------|
| C0360 | C0370 | C0380 | C0390 | C0400 |
| | | | | |

| Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | Beløb | Valutakode | Kernekapital | Supplerende kapital | Resterende supplerende kapital | Dato for tilladelse |
|---|-------|------------|--------------|---------------------|--------------------------------|---------------------|
| C0450 | C0460 | C0470 | C0480 | C0490 | C0500 | C0510 |
| | | | | | | |

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

| Beskrivelse af genstanden | I alt |
|---------------------------|-------|
| C0570 | C0580 |
| | |

| Beskrivelse af supplerende kapitalgrundlag | Beløb | Modpart | Udstedelses- dato | Dato for tilladelse |
|--|-------|---------|-------------------|---------------------|
| C0590 | C0600 | C0610 | C0620 | C0630 |
| | | | | |

Justering for ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

| Navn på ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje | | Teoretisk solvenskapitalkrav | Teoretisk solvenskapitalkrav (negative resultater sat til nul) | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Fremtidige overførsler til aktionærer | Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde |
|---|--|------------------------------|--|---|---------------------------------------|---|
| C0660 | | C0670 | C0680 | C0690 | C0700 | C0710 |
| | | | | | | |

| | | |
|---|-------|---|
| Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | R0010 | Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde |
| | | C0290 |

S.23.04.04

Liste over kapitalgrundlagselementer

| Beskrivelse af efterstillede gensidige medlemskonti | Beløb | Kategori | Valutakode | Udstedende enhed | Långiver (hvis specifik) | Omfattet af overgangsbestemmelser? | (forts.) |
|---|-------|----------|------------|------------------|--------------------------|------------------------------------|----------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | |

| Modpart (hvis specifik) | Udstedelsesdato | Udløbsdato | Dato for første indløsning | Oplysninger om senere indløsningsdatoer | Oplysninger om incitamenter til at indløse | Varselsperiode | (forts.) |
|-------------------------|-----------------|------------|----------------------------|---|--|----------------|----------|
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | |

| Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse | Tilbagekøb i årets løb | % af udstedelsen, der besiddes af enheder i koncernen | Bidrag til koncernens efterstillede gensidige medlemskonti |
|--|------------------------|---|--|
| C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |

| Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse | Navn på den pågældende enhed | Tilbagekøb i årets løb | % af udstedelsen, der besiddes af enheder i koncernen | Bidrag til koncernens andre basiskapitalgrundlagselementer |
|--|------------------------------|------------------------|---|--|
| C0520 | C0530 | C0540 | C0550 | C0560 |
| | | | | |

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

| Beskrivelse af genstanden | Samlet beløb |
|---------------------------|--------------|
| C0570 | C0580 |
| | |

| Beskrivelse af supplerende kapitalgrundlag | Beløb | Modpart | Udstedelsesdato | Dato for tilladelse | Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse | Navn på den pågældende enhed | (forts.) |
|--|-------|---------|-----------------|---------------------|--|------------------------------|----------|
| C0590 | C0600 | C0610 | C0620 | C0630 | C0640 | C0650 | |
| | | | | | | | |

Justering for ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

| Navn på ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje | Teoretisk solvenskapitalkrav | Teoretisk solvenskapitalkrav (negative resultater sat til nul) | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Fremtidige overførsler til aktionærer | Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde |
|---|------------------------------|--|---|---------------------------------------|---|
| C0660 | C0670 | C0680 | C0690 | C0700 | C0710 |
| | | | | | |

| | | | | | | |
|---|--|--|---|--|--|---|
| Samlede ikke til rådighed stående overskydende kapitalgrundlag, der skal fratrækkes | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndigheden | Ikke til rådighed stående overskudskapital | Ikke til rådighed stående indkaldt, men ikke indbetalt kapital | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag |
| C0850 | C0851 | C0750 | C0870 | C0880 | C0890 | C0900 |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--|--|---|---|--|---|--|
| Ikke til rådighed stående efterstillede gensidige medlemskonti | Ikke til rådighed stående præferenceaktier | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld | Et beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto | Ikke til rådighed stående overskurs ved emission vedrørende præferenceaktier | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i afstemningsreserven | Samlet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag |
| C0910 | C0920 | C0930 | C0940 | C0950 | C0951 | C0962 |
| | | | | | | |

| | | |
|--|----------------------|--|
| Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes | Minoritetsinteresser | Minoritetsinteresser, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag |
| C0960 | C0861 | C0860 |
| | | |

S.24.01.01

Kapitalinteresser, der besiddes

Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, (fuldt ud eller delvis) fratrukket i henhold til artikel 68 i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35

Tabel 1 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser, med henblik på fradrag i henhold til artikel 68, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2015/35

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Basiskapitalgrundlag — kernekapital | Supplerende kernekapital | Supplerende kapital |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| | | | | | | |

Tabel 2 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser, med henblik på fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Basiskapitalgrundlag — kernekapital | Supplerende kernekapital | Supplerende kapital |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|
| C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | | |

| | | | I alt | Basiskapitalgrundlag — kernekapital | Supplerende kernekapital | Supplerende kapital |
|---|-------|--|-------|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|
| | | | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, og for hvilke der er fradrag i kapitalgrundlaget | R0001 | | | | | |

Fradrag i kapitalgrundlaget

| | | I alt | Kernekapital — Ubegrænset | Kernekapital — Begrænset | Supplerende kapital |
|--------------|--|-------|------------------------------|-----------------------------|---------------------|
| | | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| R0010 | Fradrag i henhold til artikel 68, stk. 1 | | | | |
| R0020 | Fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2 | | | | |
| R0030 | I alt | | | | |

Behandling i forhold til solvenskapitalkrav

Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, ikke (fuldt ud) fratrukket i henhold til artikel 68 i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35

Tabel 3 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interesserne betragtes som strategiske som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 (intet fradrag i kapitalgrundlaget, jf. artikel 68, stk. 3).

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|---------------|-------------------|
| C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 |
| | | | | | | |

Tabel 4 — Kapitalinteresser, der besiddes i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, og som er strategiske (som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35), og ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2. (Heri bør medregnes den resterende del efter det delvise fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35).

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|---------------|-------------------|
| C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| | | | | | | |

Tabel 5 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interesserne ikke er strategiske og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. (Heri medregnes den resterende del efter det delvise fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35).

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|---------------|-------------------|
| C0370 | C0380 | C0390 | C0400 | C0410 | C0420 | C0430 |
| | | | | | | |

Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter

Tabel 6 — Andre strategiske kapitalinteresser, ikke i finansierings- og kreditinstitutter

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|---------------|-------------------|
| C0440 | C0450 | C0460 | C0470 | C0480 | C0490 | C0500 |
| | | | | | | |

Tabel 7 — Andre ikkestrategiske kapitalinteresser, ikke i finansierings- og kreditinstitutter

| Navn på tilknyttet selskab | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kodetype | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|----------------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|---------------|-------------------|
| C0510 | C0520 | C0530 | C0540 | C0550 | C0560 | C0570 |
| | | | | | | |

Sum for solvenskapitalkrav

| | I alt | Type 1-aktier | Type 2-aktier | Efterstillet gæld |
|---|-------|---------------|---------------|-------------------|
| | C0580 | C0590 | C0600 | C0610 |
| R0040 Kapitalinteresser i alt i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter | | | | |
| R0050 Heraf strategiske (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1) | | | | |
| R0060 Heraf ikke strategiske (mindre end 10 %) | | | | |
| R0070 Kapitalinteresser i alt i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter | | | | |
| R0080 Heraf strategiske | | | | |
| R0090 Heraf ikkestrategiske | | | | |

Alle kapitalinteresser i alt

Samlet for alle kapitalinteresser

| |
|-------|
| I alt |
| C0620 |
| |

S.25.01.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender standardformlen

Artikel 112

Z0010

A001

| | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer |
|-----------------------------------|-------------------------|--------------------------|--|
| | C0030 | C0040 | C0050 |
| Markedsrisiko | R0010 | | |
| Modpartsrisici | R0020 | | |
| Livsforsikringsrisiko | R0030 | | |
| Sygeforsikringsrisiko | R0040 | | |
| Skadesforsikringsrisici | R0050 | | |
| Diversifikation | R0060 | | |
| Risici på immaterielle aktiver | R0070 | | |
| Primært solvenskapitalkrav | R0100 | | |

Tilgang til skattesats

| | | |
|--|--------------|--------------|
| | | Ja/nej |
| | | C0109 |
| Tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats | R0590 | |

| | | | |
|---|--------------|--------------|--------------|
| | | Før stødet | Efter stødet |
| | | C0110 | C0120 |
| Beregning af udskudte skatters tabsabsorberende evne (LAC DT) | | | |
| DTA | R0600 | | |
| DTA fremførsel | R0610 | | |
| DTA som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle | R0620 | | |
| DTL | R0630 | | |

| | | |
|---|--------------|---------------|
| | | LAC DT |
| | | C0130 |
| LAC DT | R0640 | |
| LAC DT, begrundet i udskudte skatteforpligtelser | R0650 | |
| LAC DT, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud | R0660 | |
| LAC DT, begrundet i tilbageførsel, indeværende år | R0670 | |
| LAC DT, begrundet i tilbageførsel, kommende år | R0680 | |
| Maksimum for LAC DT | R0690 | |

| | | C0100 |
|--|--------------|-------|
| Beregning af solvenskapitalkravet | | |
| Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | R0120 | |
| Operationelle risici | R0130 | |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0140 | |
| Udsudte skatters tabsabsorberende evne | R0150 | |
| Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | R0160 | |
| Solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg | R0200 | |
| Allerede indførte kapitaltillæg | R0210 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | R0211 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | R0212 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | R0213 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | R0214 | |
| Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau | R0220 | |
| Andre oplysninger om solvenskapitalkravet | | |
| Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | R0400 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | R0410 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0420 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | R0430 | |
| Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | R0440 | |
| Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | R0450 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | R0460 | |

SR.25.01.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender standardformlen

| | Artikel 112 | Z0010 | |
|--|--|--------------|--------------------------|
| | Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| | Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |
| | | | Nettosolvenskapitalkrav |
| | | | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | | C0030 |
| | | | C0040 |
| Markedsrisiko | | R0010 | |
| Modpartsrisici | | R0020 | |
| Livsforsikringsrisiko | | R0030 | |
| Sygeforsikringsrisiko | | R0040 | |
| Skadesforsikringsrisici | | R0050 | |
| Diversifikation | | R0060 | |
| Risici på immaterielle aktiver | | R0070 | |
| Primært solvenskapitalkrav | | R0100 | |
| Beregning af solvenskapitalkravet | | | C0100 |
| Operationelle risici | | R0130 | |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | | R0140 | |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | | R0150 | |
| Solvenskapitalkrav | | R0200 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | | R0460 | |

Tilgang til skattesats

| | | |
|--|-------|--------|
| | | Ja/nej |
| | | C0109 |
| Tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats | R0590 | |

Beregning af udskudte skatters tabsabsorberende evne (LAC DT)

| | | Før stødet | Efter stødet |
|---|-------|------------|--------------|
| | | C0110 | C0120 |
| DTA | R0600 | | |
| DTA fremførsel | R0610 | | |
| DTA som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle | R0620 | | |
| DTL | R0630 | | |

| | | LAC DT |
|---|-------|--------|
| | | C0130 |
| LAC DT | R0640 | |
| LAC DT, begrundet i udskudte skatteforpligtelser | R0650 | |
| LAC DT, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud | R0660 | |
| LAC DT, begrundet i tilbageførsel, indeværende år | R0670 | |
| LAC DT, begrundet i tilbageførsel, kommende år | R0680 | |
| Maksimum for LAC DT | R0690 | |

S.25.05.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|---|-------|--------------------|--|---|------------------|
| Risikotype | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0400 | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0410 | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0510 | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0520 | | | | |
| Andre risici | R0530 | | | | |

| | | C0100 |
|---|-------|-------|
| Ikkediversificerede komponenter i alt | R0110 | |
| Diversifikation | R0060 | |
| Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | R0120 | |
| Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | R0160 | |
| Solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg | R0200 | |
| Allerede indførte kapitaltillæg | R0210 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | R0211 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | R0212 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | R0213 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | R0214 | |
| Solvenskapitalkrav | R0220 | |
| Andre oplysninger om solvenskapitalkravet | | |
| Beløb/skøn vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | R0300 | |
| Beløb/skøn vedrørende udskudte skatters samlede tabsabsorberende evne | R0310 | |
| Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | R0400 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | R0410 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0420 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | R0430 | |
| Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | R0440 | |
| Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0450 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | R0460 | |

| | | |
|--|-------|--------|
| | | Ja/nej |
| | | C0109 |
| Tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats | R0590 | |

| | | Før stødet | Efter stødet | LAC DT |
|---|-------|------------|--------------|--------|
| | | C0110 | C0120 | C0130 |
| DTA | R0600 | | | |
| DTA fremførsel | R0610 | | | |
| DTA som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle | R0620 | | | |
| DTL | R0630 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende LAC DT | R0640 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i hjemfald af udskudte skatteforpligtelser | R0650 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud | R0660 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i tilbageførsel, indeværende år | R0670 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i tilbageførsel, kommende år | R0680 | | | |
| Beløb/skøn vedrørende maksimum LAC DT | R0690 | | | |

S.25.05.04

Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|---|-------|--------------------|--|---|------------------|
| Risikotype | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0050 | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0060 | | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0400 | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0410 | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0510 | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0520 | | | | |
| Andre risici | R0530 | | | | |

| | | C0100 |
|---|-------|-------|
| Ikkediversificerede komponenter i alt | R0110 | |
| Diversifikation | R0060 | |
| Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | R0120 | |
| Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | R0160 | |
| Solvenskapitalkrav beregnet på grundlag af artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive kapitaltillæg | R0200 | |
| Allerede indførte kapitaltillæg | R0210 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | R0211 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | R0212 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | R0213 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | R0214 | |
| Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau | R0220 | |
| Andre oplysninger om solvenskapitalkravet | | |
| Beløb/skøn vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | R0300 | |
| Beløb/skøn vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0310 | |
| Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | R0400 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | R0410 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0420 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | R0430 | |

| | | C0100 |
|--|-------|-------|
| Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | R0440 | |
| Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0450 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | R0460 | |
| Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau | R0470 | |
| Oplysninger om andre enheder | | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) | R0500 | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Kreditinstitutter, investeringsselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrationselskaber | R0510 | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser | R0520 | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter | R0530 | |
| Kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber | R0540 | |
| Kapitalkrav for resterende tilknyttede selskaber | R0550 | |
| Kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde | R0555 | |
| Samlet solvenskapitalkrav | | |
| Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering. | R0560 | |
| Koncernens samlede solvenskapitalkrav | R0570 | |

S.25.05.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | |
|---|-------|--|
| Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

| Risikotype | | Solvenskapitalkrav | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|---|-------|--------------------|---|------------------|
| | | C0010 | C0060 | C0070 |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0400 | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0410 | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|--|-------|--------------------|---|------------------|
| Samlet operationel risiko | R0510 | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0520 | | | |
| Andre risici | R0530 | | | |

| | | C0100 |
|---|-------|-------|
| Ikkediversificerede komponenter i alt | R0110 | |
| Diversifikation | R0060 | |
| Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/ matchtilpasningsporteføljer | R0120 | |
| Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | R0160 | |
| Solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg | R0200 | |
| Allerede indførte kapitaltillæg | R0210 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | R0211 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | R0212 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | R0213 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | R0214 | |
| Solvenskapitalkrav | R0220 | |
| Andre oplysninger om solvenskapitalkravet | | |
| Beløb/skøn vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | R0300 | |
| Beløb/skøn vedrørende udskudte skatters samlede tabsabsorberende evne | R0310 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | R0460 | |

S.25.05.04

Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | |
|---|-------|--|
| Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|---|-------|--------------------|--|---|------------------|
| Risikotype | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0400 | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb |
|--|-------|--------------------|--|---|------------------|
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0410 | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0510 | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0520 | | | | |
| Andre risici | R0530 | | | | |

| | | C0100 |
|---|-------|-------|
| Ikkediversificerede komponenter i alt | R0110 | |
| Diversifikation | R0060 | |
| Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/ matchtilpasningsporteføljer | R0120 | |
| Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | R0160 | |
| Solvenskapitalkrav beregnet på grundlag af artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive kapitaltillæg | R0200 | |
| Allerede indførte kapitaltillæg | R0210 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | R0211 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | R0212 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | R0213 | |
| Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | R0214 | |
| Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau | R0220 | |

| | | C0100 |
|--|-------|-------|
| Andre oplysninger om solvenskapitalkravet | | |
| Beløb/skøn vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | R0300 | |
| Beløb/skøn vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0310 | |
| Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | R0400 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | R0410 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0420 | |
| Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | R0430 | |
| Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | R0440 | |
| Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | R0450 | |
| Fremtidige diskretionære nettoydelse | R0460 | |
| Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau | R0470 | |
| Oplysninger om andre enheder | | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) | R0500 | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Kreditinstitutter, investeringselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrationsselskaber | R0510 | |
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser | R0520 | |

| | | C0100 |
|--|-------|-------|
| Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav) — Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter | R0530 | |
| Kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber | R0540 | |
| Kapitalkrav for resterende selskaber | R0550 | |
| Kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde | R0555 | |
| Samlet solvenskapitalkrav | | |
| Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering. | R0560 | |
| Koncernens samlede solvenskapitalkrav | R0570 | |

S.26.01.01

Solvenskapitalkrav — Markedsrisici

Artikel 112 Z0010

Anvendte forenklinger

C0010

| | | |
|---|-------|----------------------|
| Forenklinger — Kreditspændrisici på obligationer og lån | R0012 | <input type="text"/> |
| Forenklinger ved markeds koncentrationsrisici — der er anvendt forenklinger | R0014 | <input type="text"/> |
| Forenklinger for captive-selskaber — Renterisici | R0020 | <input type="text"/> |
| Forenklinger for captive-selskaber — Kreditspændrisici på obligationer og lån | R0030 | <input type="text"/> |
| Forenklinger for captive-selskaber — Markeds koncentrationsrisici | R0040 | <input type="text"/> |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|----------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Renterisici | R0100 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Stød i form af rentefald | R0110 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Stød i form af rentestigning | R0120 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Aktierisici | R0200 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Type 1-aktier | R0210 | | | | | | | |
| Andre type 1-aktier end langfristede | R0221 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 1-aktier) | R0230 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 1-aktier) | R0231 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 1-aktier) | R0240 | | | | | | | |
| Type 2-aktier | R0250 | | | | | | | |
| Andre type 2-aktier end langfristede | R0261 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 2-aktier) | R0270 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 2-aktier) | R0271 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 2-aktier) | R0280 | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0291 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier end strategiske og langsigtede | R0293 | | | | | | | |
| strategiske kapitalandele (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0294 | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0295 | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0292 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturaktier, bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, end strategiske og langsigtede | R0296 | | | | | | | |
| strategiske kapitalinteresser (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0297 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0298 | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0300 | | | | | | | |
| Kreditspændrisici | R0400 | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0410 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0414 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0413 | | | | | | | |
| lån og obligationer (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0412 | | | | | | | |
| Kreditderivater | R0420 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|--|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Stød i nedadgående retning for kreditderivater | R0430 | | | | | | | |
| Stød i opadgående retning for kreditderivater | R0440 | | | | | | | |
| Securitiseringspositioner | R0450 | | | | | | | |
| Privilegeret STS-securitisering | R0461 | | | | | | | |
| Ikke-privilegeret STS-securitisering | R0462 | | | | | | | |
| Resecuritisering | R0480 | | | | | | | |
| Anden securitisering | R0481 | | | | | | | |
| Traditionel type 1-securitisering | R0482 | | | | | | | |
| Garanteret STS-securitisering | R0483 | | | | | | | |
| Markedskoncentrationsrisici | R0500 | | | | | | | |
| Valutarisici | R0600 | | | | | | | |
| Stigning i værdien af den udenlandske valuta | R0610 | | | | | | | |
| Fald i værdien af den udenlandske valuta | R0620 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for markedsrisikomodulet | R0700 | | | | | | | |
| Markedsrisiko i alt | R0800 | | | | | | | |

S.26.01.04

Solvenskapitalkrav — Markedsrisici

Artikel 112 Z0010

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger — Kreditspændrisici på obligationer og lån R0012

Forenklinger ved markeds koncentrationsrisici — der er anvendt forenklinger R0014

Forenklinger for captive-selskaber — Renterisici R0020

Forenklinger for captive-selskaber — Kreditspændrisici på obligationer og lån R0030

Forenklinger for captive-selskaber — Markeds koncentrationsrisici R0040

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|----------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Renterisici | R0100 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Stød i form af rentefald | R0110 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Stød i form af rentestigning | R0120 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Aktierisici | R0200 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Type 1-aktier | R0210 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |

| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Andre type 1-aktier end langfristede | R0221 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 1-aktier) | R0230 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 1-aktier) | R0231 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 1-aktier) | R0240 | | | | | | | |
| Type 2-aktier | R0250 | | | | | | | |
| Andre type 2-aktier end langfristede | R0261 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 2-aktier) | R0270 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 2-aktier) | R0271 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 2-aktier) | R0280 | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0291 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier end strategiske og langsigtede | R0293 | | | | | | | |
| strategiske kapitalandele (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0294 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0295 | | | | | | | |

| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0292 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturaktier, bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, end strategiske og langsigtede | R0296 | | | | | | | |
| strategiske kapitalinteresser (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0297 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0298 | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0300 | | | | | | | |
| Kreditspændsrisici | R0400 | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0410 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0414 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0413 | | | | | | | |
| lån og obligationer (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0412 | | | | | | | |
| Kreditderivater | R0420 | | | | | | | |
| Stød i nedadgående retning for kreditderivater | R0430 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|--|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | | | | | | | |
| Stød i opadgående retning for kreditderivater | R0440 | | | | | | | |
| Securitiseringspositioner | R0450 | | | | | | | |
| Privilegeret STS-securitisering | R0461 | | | | | | | |
| Ikke-privilegeret STS-securitisering | R0462 | | | | | | | |
| Resecuritiseringer | R0480 | | | | | | | |
| Anden securitisering | R0481 | | | | | | | |
| Traditionel type 1-securitisering | R0482 | | | | | | | |
| Garanteret STS-securitisering | R0483 | | | | | | | |
| Markedskoncentrationsrisici | R0500 | | | | | | | |
| Valutarisici | R0600 | | | | | | | |
| Stigning i værdien af den udenlandske valuta | R0610 | | | | | | | |
| Fald i værdien af den udenlandske valuta | R0620 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for markedsrisikomodulet | R0700 | | | | | | | |
| Markedsrisiko i alt | R0800 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|--|-------|--|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser (i alt) | Forpligtelser, livsforsikring | Forpligtelser, skadesforsikring | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0034 | C0035 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Aktierisici | R0200 | | | | | | | | | |
| heraf langfristet | R0205 | | | | | | | | | |
| Type 1-aktier | R0210 | | | | | | | | | |
| Andre type 1-aktier end langfristede | R0221 | | | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 1-aktier) | R0230 | | | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 1-aktier) | R0231 | | | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 1-aktier) | R0240 | | | | | | | | | |
| Type 2-aktier | R0250 | | | | | | | | | |
| Andre type 2-aktier end langfristede | R0261 | | | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 2-aktier) | R0270 | | | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 2-aktier) | R0271 | | | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 2-aktier) | R0280 | | | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0291 | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser (i alt) | Forpligtelser, livsforsikring | Forpligtelser, skadesforsikring | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0034 | C0035 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| andre kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier end strategiske og langsigtede | R0293 | | | | | | | | | |
| strategiske kapitalandele (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0294 | | | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0295 | | | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0292 | | | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturaktier, bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, end strategiske og langsigtede | R0296 | | | | | | | | | |
| strategiske kapitalinteresser (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0297 | | | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0298 | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0300 | | | | | | | | | |
| Kreditspændrisici | R0400 | | | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0410 | | | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0414 | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser (i alt) | Forpligtelser, livsforsikring | Forpligtelser, skadesforsikring | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0034 | C0035 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0413 | | | | | | | | | |
| lån og obligationer (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0412 | | | | | | | | | |
| Kreditderivater | R0420 | | | | | | | | | |
| Stød i nedadgående retning for kreditderivater | R0430 | | | | | | | | | |
| Stød i opadgående retning for kreditderivater | R0440 | | | | | | | | | |
| Securitiseringspositioner | R0450 | | | | | | | | | |
| Privilegeret STS-securitisering | R0461 | | | | | | | | | |
| Ikke-privilegeret STS-securitisering | R0462 | | | | | | | | | |
| Resecuritiseringer | R0480 | | | | | | | | | |
| Anden securitisering | R0481 | | | | | | | | | |
| Traditionel type 1-securitisering | R0482 | | | | | | | | | |
| Garanteret STS-securitisering | R0483 | | | | | | | | | |
| Markedskoncentrationsrisici | R0500 | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|--|-------|--|-----------------------|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser (i alt) | Forpligtelser, livsforsikring | Forpligtelser, skadeforsikring | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0034 | C0035 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Valutarisici | R0600 | | | | | | | | | |
| Stigning i værdien af den udenlandske valuta | R0610 | | | | | | | | | |
| Fald i værdien af den udenlandske valuta | R0620 | | | | | | | | | |
| Diversifikation inden for markedsrisikomodulet | R0700 | | | | | | | | | |
| Markedsrisiko i alt | R0800 | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

S.26.01.04

Solvenskapitalkrav — Markedsrisici

| | | |
|---|-------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

Anvendte forenklinger

C0010

| | | |
|--|-------|--|
| Forenklinger — Kreditspændsrisici på obligationer og lån | R0012 | |
| Forenklinger ved markeds koncentrationsrisici — der er anvendt forenklinger | R0014 | |
| Forenklinger for captive-selskaber — Renterisici | R0020 | |
| Forenklinger for captive-selskaber — Kreditspændsrisici på obligationer og lån | R0030 | |
| Forenklinger for captive-selskaber — Markeds koncentrationsrisici | R0040 | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Renterisici | R0100 | | | | | | | |
| Stød i form af rentefald | R0110 | | | | | | | |
| Stød i form af rentestigning | R0120 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Aktierisici | R0200 | | | | | | | |
| Type 1-aktier | R0210 | | | | | | | |
| Andre type 1-aktier end langfristede | R0221 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 1-aktier) | R0230 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 1-aktier) | R0231 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 1-aktier) | R0240 | | | | | | | |
| Type 2-aktier | R0250 | | | | | | | |
| Andre type 2-aktier end langfristede | R0261 | | | | | | | |
| Strategiske kapitalandele (type 2-aktier) | R0270 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (type 2-aktier) | R0271 | | | | | | | |
| Løbetidsbaseret (type 2-aktier) | R0280 | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0291 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier end strategiske og langsigtede | R0293 | | | | | | | |

Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | | | | | | | |
| strategiske kapitalandele (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0294 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0295 | | | | | | | |
| kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | R0292 | | | | | | | |
| andre kvalificerede infrastrukturaktier, bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, end strategiske og langsigtede | R0296 | | | | | | | |
| strategiske kapitalinteresser (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0297 | | | | | | | |
| Langsigtede aktieinvesteringer (kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) | R0298 | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0300 | | | | | | | |
| Kreditspændrisici | R0400 | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0410 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0414 | | | | | | | |
| lån og obligationer (kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0413 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|---|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| lån og obligationer (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | R0412 | | | | | | | |
| Kreditderivater | R0420 | | | | | | | |
| Stød i nedadgående retning for kreditderivater | R0430 | | | | | | | |
| Stød i opadgående retning for kreditderivater | R0440 | | | | | | | |
| Securitiseringspositioner | R0450 | | | | | | | |
| Privilegeret STS-securitisering | R0461 | | | | | | | |
| Ikke-privilegeret STS-securitisering | R0462 | | | | | | | |
| Resecuritiseringer | R0480 | | | | | | | |
| Anden securitisering | R0481 | | | | | | | |
| Traditionel type 1-securitisering | R0482 | | | | | | | |
| Garanteret STS-securitisering | R0483 | | | | | | | |
| Markedskoncentrationsrisici | R0500 | | | | | | | |
| Valutarisici | R0600 | | | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | Absolutte værdier efter stød | |
|--|-------|--|---------------|------------------------------|---|---|------------------------------|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
| Markedsrisici — Grundlæggende oplysninger | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0070 | C0060 | C0080 |
| Stigning i værdien af den udenlandske valuta | R0610 | | | | | | | |
| Fald i værdien af den udenlandske valuta | R0620 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for markedsrisikomodulet | R0700 | | | | | | | |
| Markedsrisiko i alt | R0800 | | | | | | | |

Valuta anvendt som reference til beregning af valutarisikoen

| | | |
|--|-------|-------|
| | | C0090 |
| Valuta anvendt som reference til beregning af valutarisikoen | R0810 | |

S.26.02.01

Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici

Artikel 112 Z0010

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger

R0010

| | Enkeltnavnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|--|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Type 1-eksponeringer | R0100 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 1 | R0110 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 2 | R0120 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 3 | R0130 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 4 | R0140 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 5 | R0150 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 6 | R0160 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 7 | R0170 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 8 | R0180 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 9 | R0190 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 10 | R0200 | | | | | | |

| | Enkeltnavn- seksponering | Kode for enkeltnavn- seksponering | Kodetype for enkeltnavnseks- ponering | Tab givet mislighol- delse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolven- skapitalkrav | Bruttosolvenska- pitalkrav |
|---|-----------------------------|---|---|-------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|-------------------------------|
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger | | | | | | | |
| Type 2-eksponeringer | | | | | | | |
| R0300 | | | | | | | |
| Tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder | | | | | | | |
| R0310 | | | | | | | |
| Alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder | | | | | | | |
| R0320 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for modpartsrisikomodulet | | | | | | | |
| R0330 | | | | | | | |
| Modpartsrisici i alt | | | | | | | |
| R0400 | | | | | | | |
| Nærmere oplysninger om realkreditlån | | | | | | | |
| | | C0090 | | | | | |
| Tab som følge af type 2-realkreditlån | R0500 | | | | | | |
| Samlet tab som følge af realkreditlån | R0510 | | | | | | |

S.26.02.04

Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici

Artikel 112 Z0010

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger

R0010

Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger

Type 1-eksponeringer

Enkeltnavnseksponering 1

Enkeltnavnseksponering 2

Enkeltnavnseksponering 3

Enkeltnavnseksponering 4

Enkeltnavnseksponering 5

Enkeltnavnseksponering 6

Enkeltnavnseksponering 7

Enkeltnavnseksponering 8

Enkeltnavnseksponering 9

Enkeltnavnseksponering 10

| Enkeltnavnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| R0100 | | | | | | |
| R0110 | | | | | | |
| R0120 | | | | | | |
| R0130 | | | | | | |
| R0140 | | | | | | |
| R0150 | | | | | | |
| R0160 | | | | | | |
| R0170 | | | | | | |
| R0180 | | | | | | |
| R0190 | | | | | | |
| R0200 | | | | | | |

Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger**Type 2-eksponeringer**

Tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder

Alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder

Diversifikation inden for modpartsrisikomodulet

Modpartsrisici i alt**Nærmere oplysninger om realkreditlån**

Tab som følge af type 2-realkreditlån

Samlet tab som følge af realkreditlån

| | Enkelt-navnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|--------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| R0300 | | | | | | | |
| R0310 | | | | | | | |
| R0320 | | | | | | | |
| R0330 | | | | | | | |
| R0400 | | | | | | | |

C0090**R0500**

| |
|--|
| |
|--|

R0510

| |
|--|
| |
|--|

SR.26.02.01

Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici

| | | |
|--|--------------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

Anvendte forenklinger

| | | |
|--------------|--------------|--|
| Forenklinger | R0010 | |
|--------------|--------------|--|

| | | Enkeltnavnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|--|--------------|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Type 1-eksponeringer | R0100 | X | X | X | X | X | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 1 | R0110 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 2 | R0120 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 3 | R0130 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 4 | R0140 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 5 | R0150 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 6 | R0160 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 7 | R0170 | | | | | | X | X |
| Enkeltnavnseksponering 8 | R0180 | | | | | | X | X |

| | Enkeltnavnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|---|------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| Modpartsrisici — Grundlæggende oplysninger | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Enkeltnavnseksponering 9 | R0190 | | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 10 | R0200 | | | | | | |
| Type 2-eksponeringer | R0300 | | | | | | |
| Tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder | R0310 | | | | | | |
| Alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder | R0320 | | | | | | |
| Diversifikation inden for modpartsrisikomodulet | R0330 | | | | | | |
| Modpartsrisici i alt | R0400 | | | | | | |

S.26.03.01**Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici**Artikel 112 **Z0010** **Anvendte forenklinger****C0010**

| | | |
|---|--------------|----------------------|
| Forenklinger — Dødelighedsrisici | R0010 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Levetidsrisici | R0020 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici | R0030 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Optionsrisici | R0040 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0050 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Katastroferisici for livsforsikringer | R0060 | <input type="text"/> |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0100 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0200 | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0300 | | | | | |
| Optionsrisici | R0400 | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|------------------------------|--|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | | |
| | Risici for stigning i optionsintensiteten | R0410 | | | | | | |
| | Risici for fald i optionsintensiteten | R0420 | | | | | | |
| | Masseoptionsrisici | R0430 | | | | | | |
| | Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0500 | | | | | | |
| | Genoptagelsesrisici | R0600 | | | | | | |
| | Livsforsikringskatastroferisici | R0700 | | | | | | |
| | Diversifikation inden for livsforsikringsrisikomodulet | R0800 | | | | | | |
| | Livsforsikringsrisici i alt | R0900 | | | | | | |

| | | Selskabsspecifikke parametre |
|--|--------------|------------------------------|
| Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici | | C0090 |
| Anvendt faktor ved stød i forbindelse med genoptagelse | R1000 | |

S.26.03.04

Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici

Artikel 112 Z0010

Anvendte forenklinger

C0010

| | | |
|---|-------|----------------------|
| Forenklinger — Dødelighedsrisici | R0010 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Levetidsrisici | R0020 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici | R0030 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Optionsrisici | R0040 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0050 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Katastroferisici for livsforsikringer | R0060 | <input type="text"/> |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0100 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0200 | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0300 | | | | | |
| Optionsrisici | R0400 | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|--------------|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0410 | | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0420 | | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0430 | | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0500 | | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici | R0600 | | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0700 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for livsforsikringsrisikomodulet | R0800 | | | | | | | |
| Livsforsikringsrisici i alt | R0900 | | | | | | | |
| | | Selskabsspecifikke parametre | | | | | | |
| Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici | | C0090 | | | | | | |
| Anvendt faktor ved stød i forbindelse med genoptagelse | R1000 | | | | | | | |

SR.26.03.01

Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici

| | | |
|--|--------------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

Anvendte forenklinger

| | | |
|---|--------------|--|
| | C0010 | |
| Forenklinger — Dødelighedsrisici | R0010 | |
| Forenklinger — Levetidsrisici | R0020 | |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici | R0030 | |
| Forenklinger — Optionsrisici | R0040 | |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0050 | |
| Forenklinger — Katastroferisici for livsforsikringer | R0060 | |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0100 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0200 | | | | | |

| | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0300 | | | | | | |
| Optionsrisici | R0400 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0410 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0420 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0430 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0500 | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici | R0600 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0700 | | | | | | |
| Diversifikation inden for livsforsikringsrisikomodulet | R0800 | | | | | | |
| Livsforsikringsrisici i alt | R0900 | | | | | | |

Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici

Anvendt faktor ved stød i forbindelse med genoptagelse **R1000**

| |
|------------------------------|
| Selskabsspecifikke parametre |
| C0090 |
| |

S.26.04.01

Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici

Artikel 112 **Z0010**

| |
|--|
| |
|--|

Anvendte forenklinger

C0010

| | |
|--|--------------|
| Forenklinger — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | R0010 |
| Forenklinger — Levetidsrisici for sygeforsikringer | R0020 |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | R0030 |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | R0040 |
| Forenklinger — Optionsrisici for SLT-sygeforsikring | R0050 |
| Forenklinger — Optionsrisici for NSLT-sygeforsikring | R0051 |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0060 |

| |
|--|
| |
| |
| |
| |
| |
| |
| |

SLT-sygeforsikringsrisici

Dødelighedsrisici for sygeforsikringer

R0100

Levetidsrisici for sygeforsikringer

R0200

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|---|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | | | | | | |
| Indkomstsikring | | | | | | |
| Optionsrisici for SLT-sygeforsikringer | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | | | | | | |
| Diversifikation inden for SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| SLT-sygeforsikringsrisici i alt | | | | | | |

Selskabsspecifikke parametre

C0090

Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici

Anvendt faktor ved stød i forbindelse med genoptagelse **R0900**

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V_{prem} | V_{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | | | | | | | |
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, herunder proportional genforsikring | R1000 | | | | | | |
| Forsikring vedrørende indkomstsikring, herunder proportional genforsikring | R1010 | | | | | | |
| Arbejdsskadeforsikring, herunder proportional genforsikring | R1020 | | | | | | |
| Ikkeproportional sygegenforsikring | R1030 | | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | R1040 | | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | R1050 | | | | | | |

Solvenskapitalkrav

C0180

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring **R1100**

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | | Absolutte værdier efter stød | | |
|--|--------------|--|---------------|---------|------------------------------|--------------------|--|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser | Solvenskapitalkrav | |
| | | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | R1200 | | | | | | |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | | | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav |
|--|--------------|--------------------|
| | | C0240 |
| Diversifikation inden for NSLT-sygeforsikringsrisici | R1300 | |
| NSLT-sygeforsikringsrisici i alt | R1400 | |

| | | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|---|--------------|-------------------------|--------------------------|
| | | C0250 | C0260 |
| Sygeforsikringskatastroferisici | | | |
| Masseulykkesrisici | R1500 | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R1510 | | |
| Pandemirisici | R1520 | | |
| Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici | R1530 | | |
| De samlede sygeforsikringskatastroferisici | R1540 | | |

| | | Nettosolvenskapitalkrav | Bruttosolvenskapitalkrav |
|--|--------------|-------------------------|--------------------------|
| De samlede sygeforsikringsrisici | | C0270 | C0280 |
| Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet | R1600 | | |
| De samlede sygeforsikringsrisici | R1700 | | |

S.26.04.04

Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici

Artikel 112 **Z0010**

Anvendte forenklinger

C0010

| | | |
|--|--------------|----------------------|
| Forenklinger — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | R0010 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Levetidsrisici for sygeforsikringer | R0020 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | R0030 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | R0040 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Optionsrisici for SLT-sygeforsikring | R0050 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Optionsrisici for NSLT-sygeforsikring | R0051 | <input type="text"/> |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0060 | <input type="text"/> |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | R0100 | | | | | |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|---|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| Levetidsrisici for sygeforsikringer | R0200 | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | R0300 | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0310 | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0320 | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0330 | | | | | |
| Indkomstsikring | R0340 | | | | | |
| Optionsrisici for SLT-sygeforsikringer | R0400 | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0410 | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0420 | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0430 | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0500 | | | | | |
| Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | R0600 | | | | | |
| Diversifikation inden for SLT-sygeforsikringsrisici | R0700 | | | | | |

| Standardafvigelse for præmierisici | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | | |
|--|---|--|--|-------------------|------------------|----------------------------|---|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V_{prem} | V_{res} | Geografisk diversifikation | V |
| Arbejdsskadeforsikring, proportional genforsikring | herunder | R1020 | | | | | |
| Ikkeproportional sygegenforsikring | | R1030 | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | | R1040 | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | | R1050 | | | | | |

| Solvenskapitalkrav | |
|--|--------------|
| C0180 | |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | R1100 |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | |
|---|---------------|------------------------------|---------------|--------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser | Solvenskapitalkrav |
| C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | | | | |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | | | | |
| | R1200 | | | |

| | | Solvenskapital- krav |
|--|--------------|-------------------------|
| | | C0240 |
| Diversifikation inden for NSLT-sygeforsikringsrisici | R1300 | |
| NSLT-sygeforsikringsrisici i alt | R1400 | |

| | | Nettosolvenskapital- krav | Bruttosolvenskapi- talkrav |
|---|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | C0250 | C0260 |
| Sygeforsikringskatastroferisici | | | |
| Masseulykkesrisici | R1500 | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R1510 | | |
| Pandemirisici | R1520 | | |
| Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici | R1530 | | |
| De samlede sygeforsikringskatastroferisici | R1540 | | |

| | | Nettosolvenskapital- krav | Bruttosolvenskapi- talkrav |
|--|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | C0270 | C0280 |
| De samlede sygeforsikringsrisici | | | |
| Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet | R1600 | | |
| De samlede sygeforsikringsrisici | R1700 | | |

SR.26.04.01

Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici

| | | |
|--|--------------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |

Anvendte forenklinger

| | | C0010 |
|--|--------------|--------------|
| Forenklinger — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | R0010 | |
| Forenklinger — Levetidsrisici for sygeforsikringer | R0020 | |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | R0030 | |
| Forenklinger — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | R0040 | |
| Forenklinger — Optionsrisici for SLT-sygeforsikring | R0050 | |
| Forenklinger — Optionsrisici for NSLT-sygeforsikring | R0051 | |
| Forenklinger — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0060 | |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | R0100 | | | | | |

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|---|--------------|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | | | |
| Levetidsrisici for sygeforsikringer | R0200 | | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | R0300 | | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0310 | | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0320 | | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0330 | | | | | | | |
| Indkomstsikring | R0340 | | | | | | | |
| Optionsrisici for SLT-sygeforsikringer | R0400 | | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0410 | | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0420 | | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0430 | | | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0500 | | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | R0600 | | | | | | | |
| Diversifikation inden for SLT-sygeforsikringsrisici | R0700 | | | | | | | |

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | | | |
|--|---------------|------------------------------|---|-------------------------|---|--------------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Nettosolvenskapitalkrav | Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) | Bruttosolvenskapitalkrav |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| SLT-sygeforsikringsrisici | | | | | | |
| SLT-sygeforsikringsrisici i alt | R0800 | | | | | |

| Selskabsspecifikke parametre | |
|--|-------|
| Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici | C0090 |
| Anvendt faktor ved stød i forbindelse med genoptagelse | R0900 |

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V _{prem} | V _{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | | | | | | | |
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, herunder proportional genforsikring | R1000 | | | | | | |
| Forsikring vedrørende indkomstsikring, herunder proportional genforsikring | R1010 | | | | | | |

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|---|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V _{prem} | V _{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | | | | | | | |
| Arbejdsskadeforsikring, herunder proportional genforsikring | R1020 | | | | | | |
| Ikkeproportional sygegenforsikring | R1030 | | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | R1040 | | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | R1050 | | | | | | |

| Solvenskapitalkrav |
|--------------------|
| C0180 |
| |

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring **R1100**

| Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | |
|--|---------------|------------------------------|---------------|--------------------|
| Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser | Solvenskapitalkrav |
| C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | | | | |
| Optionsrisici for NSLT-sygeforsikringer | R1200 | | | |

| | | |
|--|--------------|---------------------------------|
| | | Solvenskapital- krav |
| | | C0240 |
| Diversifikation inden for NSLT-sygeforsikringsrisici | R1300 | |
| NSLT-sygeforsikringsrisici i alt | R1400 | |

| | | Nettosolvenskapital- krav | Bruttosolvenskapi- talkrav |
|---|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | C0250 | C0260 |
| Sygeforsikringskatastroferisici | | | |
| Masseulykkesrisici | R1500 | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R1510 | | |
| Pandemirisici | R1520 | | |
| Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici | R1530 | | |
| De samlede sygeforsikringskatastroferisici | R1540 | | |

| | | Nettosolvenskapital- krav | Bruttosolvenskapi- talkrav |
|--|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | C0270 | C0280 |
| De samlede sygeforsikringsrisici | | | |
| Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet | R1600 | | |
| De samlede sygeforsikringsrisici | R1700 | | |

S.26.05.01

Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici

Artikel 112 **Z0010**

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger for captive-selskaber — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici **R0010**

Anvendte forenklinger — skadesforsikringsoptionsrisici **R0011**

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | | |
|---|---|--|---|--|------------------|----------------------------|--------------|--------------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V_{prem} | V_{res} | Geografisk diversifikation | V | |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Motoransvarsforsikring R0100 | | | | | | | | |
| Motorforsikring, andre klasser R0110 | | | | | | | | |
| Sø-, luftfarts- og transportforsikring R0120 | | | | | | | | |
| Brand og anden skade på ejendom R0130 | | | | | | | | |
| Almindelig ansvarsforsikring R0140 | | | | | | | | |
| Kredit- og kaufionsforsikring R0150 | | | | | | | | |
| Retshjælpsforsikring R0160 | | | | | | | | |

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V_{prem} | V_{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | | | | | | | |
| Assistance | R0170 | | | | | | |
| Diverse | R0180 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ejendom | R0190 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ulykke | R0200 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — sø, luftfart og transport | R0210 | | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | R0220 | | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | R0230 | | | | | | |

| |
|---------------------------|
| Solvenskapitalkrav |
|---------------------------|

| |
|--------------|
| C0100 |
|--------------|

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer **R0300**

| |
|--|
| |
|--|

S.26.05.04

Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici

Artikel 112 **Z0010**

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger for captive-selskaber — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici **R0010**

Anvendte forenklinger — skadesforsikringsoptionsrisici **R0011**

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|---|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V_{prem} | V_{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | | | | | | | |
| Motoransvarsforsikring | R0100 | | | | | | |
| Motorforsikring, andre klasser | R0110 | | | | | | |
| Sø-, luftfarts- og transportforsikring | R0120 | | | | | | |
| Brand og anden skade på ejendom | R0130 | | | | | | |
| Almindelig ansvarsforsikring | R0140 | | | | | | |
| Kredit- og kaufionsforsikring | R0150 | | | | | | |
| Retshjælpsforsikring | R0160 | | | | | | |

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V _{prem} | V _{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | | | | | | | |
| Assistance | R0170 | | | | | | |
| Diverse | R0180 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ejendom | R0190 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ulykke | R0200 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — sø, luftfart og transport | R0210 | | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | R0220 | | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | R0230 | | | | | | |

Solvenskapitalkrav

C0100

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer **R0300**

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | |
|--|-------|--|---------------|------------------------------|---------------|--------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser | Solvenskapitalkrav |
| | | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 |
| Skadesforsikringsoptionsrisici | R0400 | | | | | |
| | | Solvenskapitalkrav | | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici | R0500 | C0160 | | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici | | | | | | |
| De samlede skadesforsikringsrisici | | | | | | |
| Diversifikation inden for skadesforsikringsrisikomodulet | R0600 | | | | | |
| De samlede skadesforsikringsrisici | R0700 | | | | | |

SR.26.05.01

Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici

Artikel 112

Z0010

| |
|--|
| |
|--|

Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del

Z0020

| |
|--|
| |
|--|

Fonds-/porteføljenummer

Z0030

| |
|--|
| |
|--|

Anvendte forenklinger

C0010

Forenklinger for captive-selskaber — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici

R0010

| |
|--|
| |
|--|

Anvendte forenklinger — skadesforsikringsoptionsrisici

R0011

| |
|--|
| |
|--|

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer

Motoransvarsforsikring

R0100

Motorforsikring, andre klasser

R0110

Sø-, luftfarts- og transportforsikring

R0120

Brand og anden skade på ejendom

R0130

Almindelig ansvarsforsikring

R0140

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V _{prem} | V _{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |

| Standardafvigelse for præmierisici | | | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | | | |
|--|---|--|---|--|------------------|----------------------------|-------|
| Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse | Selskabsspecifikke parametre Standardafvigelse brutto/netto | Selskabsspecifikke parametre Justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Selskabsspecifikke parametre | V _{prem} | V _{res} | Geografisk diversifikation | V |
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | | | | | | | |
| Kredit- og kautionsforsikring | R0150 | | | | | | |
| Retshjælpsforsikring | R0160 | | | | | | |
| Assistance | R0170 | | | | | | |
| Diverse | R0180 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ejendom | R0190 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — ulykke | R0200 | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring — sø, luftfart og transport | R0210 | | | | | | |
| Samlet mængdeangivelse | R0220 | | | | | | |
| Kombineret standardafvigelse | R0230 | | | | | | |

| |
|---------------------------|
| Solvenskapitalkrav |
|---------------------------|

| |
|--------------|
| C0100 |
|--------------|

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer **R0300**

| |
|--|
| |
|--|

| | | Oprindelige absolutte værdier før stød | | Absolutte værdier efter stød | | |
|--|-------|--|---------------|------------------------------|---------------|--------------------|
| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver | Forpligtelser | Solvenskapitalkrav |
| | | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 |
| Skadesforsikringsoptionsrisici | R0400 | | | | | |
| | | Solvenskapitalkrav | | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici | R0500 | C0160 | | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici | | | | | | |
| De samlede skadesforsikringsrisici | | | | | | |
| Diversifikation inden for skadesforsikringsrisikomodulet | R0600 | | | | | |
| De samlede skadesforsikringsrisici | R0700 | | | | | |

S.26.06.01

Solvenskapitalkrav — Operationelle risici

Artikel 112 Z0010

| |
|--|
| |
|--|

Kapitalkrav

C0020

Operationelle risici — Oplysninger om forsikringsmæssige hensættelser

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for livsforsikring (undtagen risikomargin)

R0100

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for unit-linked livsforsikring (undtagen risikomargin)

R0110

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for skadesforsikring (undtagen risikomargin)

R0120

Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser.

R0130

Operationelle risici — Oplysninger om præmieindtægter

Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (seneste 12 måneder)

R0200

Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (seneste 12 måneder)

R0210

Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (seneste 12 måneder)

R0220

Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0230

Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0240

Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0250

Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter

R0260

Operationelle risici — beregning af solvenskapitalkravet

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici før anvendelse af loft

R0300

Procent af det primære solvenskapitalkrav

R0310

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici efter anvendelse af loft

R0320

Omkostninger ved unit linked virksomhed (seneste 12 måneder)

R0330

Samlet kapitalkrav for operationelle risici

R0340

| |
|-------|
| C0020 |
| R0100 |
| R0110 |
| R0120 |
| R0130 |
| |
| R0200 |
| R0210 |
| R0220 |
| R0230 |
| R0240 |
| R0250 |
| R0260 |
| |
| R0300 |
| R0310 |
| R0320 |
| R0330 |
| R0340 |

S.26.06.04

Solvenskapitalkrav — Operationelle risici

Artikel 112 Z0010

| |
|--|
| |
|--|

Kapitalkrav

C0020

Operationelle risici — Oplysninger om forsikringsmæssige hensættelser

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for livsforsikring (undtagen risikomargin)

R0100

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for unit-linked livsforsikring (undtagen risikomargin)

R0110

Forsikringsmæssige bruttohensættelser for skadesforsikring (undtagen risikomargin)

R0120

Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser.

R0130

Operationelle risici — Oplysninger om præmieindtægter

Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (seneste 12 måneder)

R0200

Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (seneste 12 måneder)

R0210

Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (seneste 12 måneder)

R0220

Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0230

Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0240

Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder)

R0250

Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter

R0260

Operationelle risici — beregning af solvenskapitalkravet

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici før anvendelse af loft

R0300

Procent af det primære solvenskapitalkrav

R0310

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici efter anvendelse af loft

R0320

Omkostninger ved unit linked virksomhed (seneste 12 måneder)

R0330

Samlet kapitalkrav for operationelle risici

R0340

| |
|-------|
| C0020 |
| R0100 |
| R0110 |
| R0120 |
| R0130 |
| |
| R0200 |
| R0210 |
| R0220 |
| R0230 |
| R0240 |
| R0250 |
| R0260 |
| |
| R0300 |
| R0310 |
| R0320 |
| R0330 |
| R0340 |

SR.26.06.01

Solvenskapitalkrav — Operationelle risici

| | | | |
|---|--|-------|--------------------|
| | Artikel 112 | Z0010 | |
| | Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| | Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |
| | | | Kapitalkrav |
| Operationelle risici — Oplysninger om forsikringsmæssige hensættelser | | | C0020 |
| Forsikringsmæssige bruttohensættelser for livsforsikring (undtagen risikomargin) | | R0100 | |
| Forsikringsmæssige bruttohensættelser for unit-linked livsforsikring (undtagen risikomargin) | | R0110 | |
| Forsikringsmæssige bruttohensættelser for skadesforsikring (undtagen risikomargin) | | R0120 | |
| Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser. | | R0130 | |
| Operationelle risici — Oplysninger om præmieindtægter | | | |
| Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (seneste 12 måneder) | | R0200 | |
| Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (seneste 12 måneder) | | R0210 | |
| Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (seneste 12 måneder) | | R0220 | |
| Bruttopræmieindtægter for livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | | R0230 | |
| Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | | R0240 | |
| Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | | R0250 | |
| Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter | | R0260 | |
| Operationelle risici — beregning af solvenskapitalkravet | | | |

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici før anvendelse af loft

Procent af det primære solvenskapitalkrav

Kapitalkrav til dækning af operationelle risici efter anvendelse af loft

Omkostninger ved unit linked virksomhed (seneste 12 måneder)

Samlet kapitalkrav for operationelle risici

R0300

R0310

R0320

R0330

R0340

| |
|--|
| |
| |
| |
| |
| |

S.26.07.01

Solvenskapitalkrav — Forenklinger

| | | |
|--|--------------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Valuta for renterisici (captive-selskaber) | Z0040 | |

Markedsrisiko

Kreditspændsrisici (obligationer og lån) (inklusive captive-selskaber)

| Kreditkvalitetstrin | | | | | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------------------------|
| 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | Der foreligger ingen vurdering |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Markedsværdi | R0010 | | | | | | |
| Modifieret varighed | R0020 | | | | | | |

C0090

Stigning i forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked forsikringsvirksomhed **R0030**

| |
|--|
| |
|--|

Renterisici (captive-selskaber)

| Kapitalkrav | |
|---------------|--------------|
| Rentestigning | Rentefald |
| C0100 | C0110 |
| Valuta | R0040 |

| | Risikosum | Risikosum t+1 | Genkøbspåvirkning | Det bedste skøn | Gennemsnitlig sats t+1 | Gennemsnitlig sats t+2 | Modificeret varighed | Gennemsnitlig afløbsperiode | Opsigelsesprocent | Betalinger | Gennemsnitlig inflationsrate |
|---|--------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|------------|------------------------------|
| | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) | R0230 | | | | | | | | | | |
| SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (op) | R0240 | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (ned) | R0250 | | | | | | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0260 | | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Markedskoncentrationsrisici

C0300

Gældsporteføljeandel

R0300

NAT CAT-forenklinger

C0330

Storm

R0400

Hagl

R0410

Jordskælv

R0420

Oversvømmelse

R0430

Jordskred

R0060

S.26.07.04

Solvenskapitalkrav — Forenklinger

Artikel 112 **Z0010**

Valuta for renterisici (captive-selskaber) **Z0040**

Markedsrisiko

**Kreditspændrisici (obligationer og lån)
(inklusive captive-selskaber)**

Markedsværdi

Modificeret varighed

R0010

R0020

| Kreditkvalitetstrin | | | | | | | |
|---------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------------------------------|
| 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | Der foreligger ingen vurdering |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |

C0090

Stigning i forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked forsikringsvirksomhed **R0030**

Renterisici (captive-selskaber)

Valuta 1

R0040

| Kapitalkrav | |
|---------------|-----------|
| Rentestigning | Rentefald |
| C0100 | C0110 |
| | |

| | Risikosum | Risikosum t+1 | Genkøbspåvirkning | Det bedste skøn | Gennemsnitlig sats t+1 | Gennemsnitlig sats t+2 | Modificeret varighed | Gennemsnitlig afløbsperiode | Opsigelsesprocent | Betalinger | Gennemsnitlig inflationsrate |
|---|--------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|------------|------------------------------|
| | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) | R0230 | | | | | | | | | | |
| SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (op) | R0240 | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (ned) | R0250 | | | | | | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer | R0260 | | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Markedskoncentrationsrisici

Gældsporteføljende

R0300

C0300

NAT CAT-forenklinger

Storm

R0400

Hagl

R0410

Jordskælv

R0420

Oversvømmelse

R0430

Jordskred

R0060

C0330

SR.26.07.01

Solvenskapitalkrav — Forenklinger

| | | |
|--|--------------|--|
| Artikel 112 | Z0010 | |
| Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Z0020 | |
| Fonds-/porteføljenummer | Z0030 | |
| Valuta for renterisici (captive-selskaber) | Z0040 | |

| Markedsrisiko | | Kreditkvalitetstrin | | | | | | | |
|---|--------------|---------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------------------------|
| | | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | Der foreligger ingen vurdering |
| Kreditspændsrisici (obligationer og lån) (inklusive captive-selskaber) | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Markedsværdi | R0010 | | | | | | | | |
| Modificeret varighed | R0020 | | | | | | | | |

C0090

| | | |
|---|--------------|--|
| Stigning i forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked forsikringsvirksomhed | R0030 | |
|---|--------------|--|

| Renterisici (captive-selskaber) | | Kapitalkrav | |
|---------------------------------|--------------|---------------|--------------|
| | | Rentestigning | Rentefald |
| | | C0100 | C0110 |
| Valuta | R0040 | | |

| | Risikosum | Risikosum t+1 | Genkøbspåvirkning | Det bedste skøn | Gennemsnitlig sats t+1 | Gennemsnitlig sats t+2 | Modificeret varighed | Gennemsnitlig afløbsperiode | Opsigelsesprocent | Betalinger | Gennemsnitlig inflationsrate |
|--|-----------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|------------------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|------------|------------------------------|
| | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| Livsforsikringsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) R0230 | | | | | | | | | | | |
| SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (op) R0240 | | | | | | | | | | | |
| Optionsrisici (ned) R0250 | | | | | | | | | | | |
| Omkostningsrisici for sygeforsikringer R0260 | | | | | | | | | | | |

Markedsrisici — Markedskoncentrationsrisici

C0300

Gældsporteføljeandel

R0300

NAT CAT-forenklinger

C0330

Storm

R0400

Hagl

R0410

Jordskælv

R0420

Oversvømmelse

R0430

Jordskred

R0060

S.26.08.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|--|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Risikotype | | | | | | |
| Samlede værdi for fritstående risiko | R0010 | | | | | |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | | |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0050 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0060 | | | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | | |
| Renterisici | R0090 | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0100 | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0110 | | | | | |
| Aktierisici | R0120 | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0130 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Ejendomsrisici | R0140 | | | | | |
| Valutarisici | R0150 | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0160 | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici (migration og misligholdelse) | R0170 | | | | | |
| Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | R0180 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0210 | | | | | |
| Risici ved derivater | R0220 | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0230 | | | | | |
| Likviditetsrisiko | R0240 | | | | | |
| Pensionsrisici | R0250 | | | | | |
| Koncentrationsrisiko | R0260 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Samlet forsikringsrisiko | R0290 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | R0300 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | | |
| Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | R0330 | | | | | |
| Menneskeskabte risici, opgjort netto | R0340 | | | | | |
| Bruttoerstatningshensættelsesrisici | R0350 | | | | | |
| Bruttopræmierisici | R0360 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0370 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0380 | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0390 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0400 | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0410 | | | | | |
| Genoptagelse | R0420 | | | | | |
| Omkostningsrisici | R0430 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Genoptagelsesrisici | R0440 | | | | | |
| Katastroferisici | R0450 | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0460 | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0470 | | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0480 | | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0490 | | | | | |
| Andre risici | R0500 | | | | | |
| Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | R0510 | | | | | |

| Modellerede specifikke risici | | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | Markeds- og kreditrisici | Skadesforsikring | Livs- og sygeforsikringsrisici | Operationel risiko | Andet |
|---|--------------|--------------------------------------|--------------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Inflationsrisiko | R0700 | | | | | | |
| Kreditspændrisiko for statsobligationer | R0710 | | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0720 | | | | | | |

Modellerede specifikke risici

| | | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | Markeds- og kreditrisici | Skadesforsikring | Livs- og sygeforsikringsrisici | Operationel risiko | Andet |
|--|--------------|--------------------------------------|--------------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Likviditetsrisiko | R0730 | | | | | | |
| Pensionsrisici | R0740 | | | | | | |
| Koncentrationsrisiko | R0750 | | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0760 | | | | | | |
| Risici ved derivater | R0770 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici + invaliditets- og sygdomsrisici | R0780 | | | | | | |
| Livsforsikringsrisici + SLT-sygeforsikringsrisici | R0790 | | | | | | |
| Naturkatastroferisici + menneskeskabte katastroferisici | R0800 | | | | | | |
| Præmierisici + erstatningshensættelsesrisici + naturkatastroferisici | R0810 | | | | | | |
| Skadesforsikringsrisici + SLT-sygeforsikringsrisici | R0820 | | | | | | |

S.26.08.04

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Risikotype | | | | | | |
| Samlede værdi for fritstående risiko | R0010 | | | | | |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | | |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | | |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0050 | | | | | |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0060 | | | | | |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | | |
| Renterisici | R0090 | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0100 | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0110 | | | | | |
| Aktierisici | R0120 | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0130 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Ejendomsrisici | R0140 | | | | | |
| Valutarisici | R0150 | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0160 | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici (migration og misligholdelse) | R0170 | | | | | |
| Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | R0180 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0210 | | | | | |
| Risici ved derivater | R0220 | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0230 | | | | | |
| Likviditetsrisiko | R0240 | | | | | |
| Pensionsrisici | R0250 | | | | | |
| Koncentrationsrisiko | R0260 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Samlet forsikringsrisiko | R0290 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | R0300 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | | |
| Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | R0330 | | | | | |
| Menneskeskabte risici, opgjort netto | R0340 | | | | | |
| Bruttoerstatningshensættelsesrisici | R0350 | | | | | |
| Bruttopræmierisici | R0360 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0370 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0380 | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0390 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0400 | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0410 | | | | | |
| Genoptagelse | R0420 | | | | | |
| Omkostningsrisici | R0430 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Genoptagelsesrisici | R0440 | | | | | |
| Katastroferisici | R0450 | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0460 | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0470 | | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0480 | | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0490 | | | | | |
| Andre risici | R0500 | | | | | |
| Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | R0510 | | | | | |

| Modellerede specifikke risici | | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | Markeds- og kreditrisici | Skadesforsikring | Livs- og sygeforsikringsrisici | Operationel risiko | Andet |
|---|--------------|--------------------------------------|--------------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Inflationsrisiko | R0700 | | | | | | |
| Kreditspændrisiko for statsobligationer | R0710 | | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0720 | | | | | | |

| Modellerede specifikke risici | | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | Markeds- og kreditrisici | Skadesforsikring | Livs- og sygeforsikringsrisici | Operationel risiko | Andet |
|--|--------------|--------------------------------------|--------------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Likviditetsrisiko | R0730 | | | | | | |
| Pensionsrisici | R0740 | | | | | | |
| Koncentrationsrisiko | R0750 | | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0760 | | | | | | |
| Risici ved derivater | R0770 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici + invaliditets- og sygdomsrisici | R0780 | | | | | | |
| Livsforsikringsrisici + SLT-sygeforsikringsrisici | R0790 | | | | | | |
| Naturkatastroferisici + menneskeskabte katastroferisici | R0800 | | | | | | |
| Præmierisici + erstatningshensættelsesrisici + naturkatastroferisici | R0810 | | | | | | |
| Skadesforsikringsrisici + SLT-sygeforsikringsrisici | R0820 | | | | | | |

SR.26.08.01

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del

Z0020

| |
|--|
| |
|--|

Fonds-/porteføljenummer

Z0030

| |
|--|
| |
|--|

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|--|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Risikotype | | X | X | X | X | X |
| Samlede værdi for fritstående risiko | R0010 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | | X |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0050 | | | | | X |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0060 | | | | | X |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | | X |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | | X |
| Renterisici | R0090 | | | | | X |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0100 | | | | | X |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Inflationsrisiko | R0110 | | | | | |
| Aktierisici | R0120 | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0130 | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0140 | | | | | |
| Valutarisici | R0150 | | | | | |
| Kreditspændrisiko | R0160 | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici (migration og misligholdelse) | R0170 | | | | | |
| Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | R0180 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0210 | | | | | |
| Risici ved derivater | R0220 | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0230 | | | | | |
| Likviditetsrisiko | R0240 | | | | | |
| Pensionsrisici | R0250 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Koncentrationsrisiko | R0260 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko | R0290 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | R0300 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | | |
| Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | R0330 | | | | | |
| Menneskeskabte risici, opgjort netto | R0340 | | | | | |
| Bruttoerstatningshensættelsesrisici | R0350 | | | | | |
| Bruttopræmierisici | R0360 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0370 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0380 | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0390 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0400 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0410 | | | | | |
| Genoptagelse | R0420 | | | | | |
| Omkostningsrisici | R0430 | | | | | |
| Genoptagelsesrisici | R0440 | | | | | |
| Katastroferisici | R0450 | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0460 | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0470 | | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0480 | | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0490 | | | | | |
| Andre risici | R0500 | | | | | |
| Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | R0510 | | | | | |

SR.26.08.04

Solvenskapitalkrav — For selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del

Z0020

| |
|--|
| |
|--|

Fonds-/porteføljenummer

Z0030

| |
|--|
| |
|--|

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|--|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Risikotype | | X | X | X | X | X |
| Samlede værdi for fritstående risiko | R0010 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversifikation | R0020 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | R0030 | | | | | X |
| Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | R0040 | | | | | X |
| Udskudte skatters tabsabsorberende evne | R0050 | | | | | X |
| Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | R0060 | | | | | X |
| Samlet markeds- og kreditrisiko | R0070 | | | | | X |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0080 | | | | | X |
| Renterisici | R0090 | | | | | X |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0100 | | | | | X |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Inflationsrisiko | R0110 | | | | | |
| Aktierisici | R0120 | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0130 | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0140 | | | | | |
| Valutarisici | R0150 | | | | | |
| Kreditspændrisiko | R0160 | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici (migration og misligholdelse) | R0170 | | | | | |
| Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | R0180 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | R0190 | | | | | |
| Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0200 | | | | | |
| Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | R0210 | | | | | |
| Risici ved derivater | R0220 | | | | | |
| Kapitalinteresser | R0230 | | | | | |
| Likviditetsrisiko | R0240 | | | | | |
| Pensionsrisici | R0250 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|--|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Koncentrationsrisiko | R0260 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko | R0270 | | | | | |
| Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | R0280 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko | R0290 | | | | | |
| Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | R0300 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici | R0310 | | | | | |
| De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | R0320 | | | | | |
| Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | R0330 | | | | | |
| Menneskeskabte risici, opgjort netto | R0340 | | | | | |
| Bruttoerstatningshensættelsesrisici | R0350 | | | | | |
| Bruttopræmierisici | R0360 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | R0370 | | | | | |
| De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | R0380 | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0390 | | | | | |
| Levetidsrisici | R0400 | | | | | |

| | | Solvenskapitalkrav | Fordeling af justeringer som følge af ringfenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Modelleret beløb | Risikobeskrivelse |
|---|--------------|--------------------|---|---|------------------|-------------------|
| | | C0010 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Invaliditets- og sygdomsrisici | R0410 | | | | | |
| Genoptagelse | R0420 | | | | | |
| Omkostningsrisici | R0430 | | | | | |
| Genoptagelsesrisici | R0440 | | | | | |
| Katastroferisici | R0450 | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0460 | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0470 | | | | | |
| Samlet operationel risiko | R0480 | | | | | |
| Samlet operationel risiko — diversificeret | R0490 | | | | | |
| Andre risici | R0500 | | | | | |
| Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | R0510 | | | | | |

S.26.09.01

Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder

| | | C0010 |
|--|--------------|-------|
| Anvendt type volatilitetsjustering | R0010 | |
| Type chokmodel for markedsrisici | R0020 | |
| Type chokmodel for kreditrisici | R0030 | |
| Dækning af ikke-finansielle instrumenter | R0040 | |

| | | mVaR 99,50 % | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser (TP) | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen (IR) | mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden andre overgangsforanstaltninger | mVaR 99,50 % uden matchningstilpasning (MA) og uden andre foranstaltninger | Marginal fordeling | | | | |
|---|--------------|--------------|---|---|--|--|--------------------|-------------------|------------|------------|-----------|
| | | | | | | | Middelværdi | Standardafvigelse | mVaR 0,001 | mVaR 0,005 | mVaR 0,01 |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2-komponenter) | R0010 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0020 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificering | R0030 | | | | | | | | | | |
| Individuel markedsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Summen af renterisici | R0040 | | | | | | | | | | |
| heraf: Diversificeret renterisici | R0050 | | | | | | | | | | |
| Renterisici | R0060 | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | mVaR 99,50 % | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser (TP) | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen (IR) | mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden andre overgangsforanstaltninger | mVaR 99,50 % uden matchningstilpasning (MA) og uden andre foranstaltninger | Marginal fordeling | | | | |
|---|--------------|---|---|--|--|--------------------|-------------------|------------|------------|-----------|
| | | | | | | Middelværdi | Standardafvigelse | mVaR 0,001 | mVaR 0,005 | mVaR 0,01 |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0070 | | | | | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0080 | | | | | | | | | |
| Summen af aktierisici | R0090 | | | | | | | | | |
| heraf: Summen af aktierisici diversificeret | R0100 | | | | | | | | | |
| Aktierisici | R0110 | | | | | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0120 | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0130 | | | | | | | | | |
| Valutarisici | R0140 | | | | | | | | | |
| Summen af kreditrisici | R0150 | | | | | | | | | |
| heraf: Kreditrisici diversificeret | R0160 | | | | | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici ("migration og misligholdelse") | R0170 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0180 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisici "Regeringer og centralbanker" | R0190 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko, øvrige | R0200 | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Marginal fordeling | | | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|----------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| | | mVaR 0,05 | mVaR 0,1 | mVaR 0,2 | mVaR 0,25 | mVaR 0,3 | mVaR 0,4 | mVaR 0,5 | mVaR 0,6 | mVaR 0,7 | mVaR 0,75 |
| | | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 |
| Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2-komponenter) | R0010 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0020 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificering | R0030 | | | | | | | | | | |
| Individuel markedsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Summen af renterisici | R0040 | | | | | | | | | | |
| heraf: Diversificeret renterisici | R0050 | | | | | | | | | | |
| Renterisici | R0060 | | | | | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0070 | | | | | | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0080 | | | | | | | | | | |
| Summen af aktierisici | R0090 | | | | | | | | | | |
| heraf: Summen af aktierisici diversificeret | R0100 | | | | | | | | | | |
| Aktierisici | R0110 | | | | | | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0120 | | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0130 | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Marginal variation | | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|----------|------------|-----------|------------|-----------|------------|------------|------------|
| | | mVaR 0,8 | mVaR 0,9 | mVaR 0,975 | mVaR 0,98 | mVaR 0,985 | mVaR 0,99 | mVaR 0,995 | mVaR 0,997 | mVaR 0,999 |
| | | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificering | R0030 | | | | | | | | | |
| Individuel markedsrisiko | | | | | | | | | | |
| Summen af renterisici | R0040 | | | | | | | | | |
| heraf: Diversificeret renterisici | R0050 | | | | | | | | | |
| Renterisici | R0060 | | | | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0070 | | | | | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0080 | | | | | | | | | |
| Summen af aktierisici | R0090 | | | | | | | | | |
| heraf: Summen af aktierisici diversificeret | R0100 | | | | | | | | | |
| Aktierisici | R0110 | | | | | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0120 | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0130 | | | | | | | | | |
| Valutarisici | R0140 | | | | | | | | | |

| | | Marginal variation | | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|----------|------------|-----------|------------|-----------|------------|------------|------------|
| | | mVaR 0,8 | mVaR 0,9 | mVaR 0,975 | mVaR 0,98 | mVaR 0,985 | mVaR 0,99 | mVaR 0,995 | mVaR 0,997 | mVaR 0,999 |
| | | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 |
| Summen af kreditrisici | R0150 | | | | | | | | | |
| heraf: Kreditrisici diversificeret | R0160 | | | | | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici ("migration og misligholdelse") | R0170 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0180 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisici "Regeringer og centralbanker" | R0190 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko, øvrige | R0200 | | | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| Individuelle stød | | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for renter | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0210 | | | | | | |
| Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| - 100bp | R0220 | | | | | | |
| + 100bp | R0230 | | | | | | |
| - 50bp | R0240 | | | | | | |
| + 50bp | R0250 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for inflationsrater | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0260 | | | | | | |
| Inflationsrater | | | | | | | |
| - 100bp | R0270 | | | | | | |
| + 100bp | R0280 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for kreditspænd | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0290 | | | | | | |
| Spænd (ensartet forskydning — alle løbetider og aktiver) | | | | | | | |
| - 100bp | R0300 | | | | | | |
| + 100bp | R0310 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for aktieværdier | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| referencescenario / intet stød | R0320 | | | | | | |
| Aktier (ensartet forskydning i værdier) | | | | | | | |
| - 30 % | R0330 | | | | | | |
| + 30 % | R0340 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for ejendomsrisici | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0350 | | | | | | |
| Ejendom (ensartet forskydning i værdier) | | | | | | | |
| - 30 % | R0360 | | | | | | |
| + 30 % | R0370 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for valutarisici | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0380 | | | | | | |
| Valuta (ensartet forskydning i valutakurser) | | | | | | | |
| -10 % | R0390 | | | | | | |
| + 10 % | R0400 | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit- linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit- linked |
|---|--------------|---------|---------------|--------------------------------|-----------------------------------|---|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| Eksponering, der er følsom over for rentevolatilitet | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0410 | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko (ned) | | | | | | | |
| – 25 % | R0420 | | | | | | |
| – 20 basispoint for normal volatilitet | R0430 | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko (op) | | | | | | | |
| + 25 % | R0440 | | | | | | |
| + 20 basispoint for normal volatilitet | R0450 | | | | | | |
| Eksponering, der er følsom over for aktievolatilitet | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0460 | | | | | | |
| Aktievolatilitet (ned) | | | | | | | |
| – 25 % | R0470 | | | | | | |
| Aktievolatilitet (op) | | | | | | | |
| + 25 % | R0480 | | | | | | |

S.26.09.04

Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder

| | | |
|--|--------------|--------------|
| | | C0010 |
| Type chokmodel for markedsrisici | R0020 | |
| Type chokmodel for kreditrisici | R0030 | |
| Dækning af ikke-finansielle instrumenter | R0040 | |

| | | mVaR 99,50 % | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser (TP) | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen (IR) | mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden andre overgangsforanstaltninger | mVaR 99,50 % uden matchningstilpasning (MA) og uden andre foranstaltninger | Marginal fordeling | | | | |
|---|--------------|--------------|---|---|--|--|--------------------|-------------------|------------|------------|-----------|
| | | | | | | | Middelværdi | Standardafvigelse | mVaR 0,001 | mVaR 0,005 | mVaR 0,01 |
| | | | | | | | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2-komponenter) | R0010 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0020 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificering | R0030 | | | | | | | | | | |
| Individuel markedsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Summen af renterisici | R0040 | | | | | | | | | | |
| heraf: Diversificeret renterisici | R0050 | | | | | | | | | | |
| Renterisici | R0060 | | | | | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0070 | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | mVaR 99,50 % | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser (TP) | mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen (IR) | mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden andre overgangsforanstaltninger | mVaR 99,50 % uden matchningstilpasning (MA) og uden andre foranstaltninger | Marginal fordeling | | | | |
|---|--------------|---|---|--|--|--------------------|-------------------|------------|------------|-----------|
| | | | | | | Middelværdi | Standardafvigelse | mVaR 0,001 | mVaR 0,005 | mVaR 0,01 |
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| Inflationsrisiko | R0080 | | | | | | | | | |
| Summen af aktierisici | R0090 | | | | | | | | | |
| heraf: Summen af aktierisici diversificeret | R0100 | | | | | | | | | |
| Aktierisici | R0110 | | | | | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0120 | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0130 | | | | | | | | | |
| Valutarisici | R0140 | | | | | | | | | |
| Summen af kreditrisici | R0150 | | | | | | | | | |
| heraf: Kreditrisici diversificeret | R0160 | | | | | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici ("migration og misligholdelse") | R0170 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0180 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisici "Regeringer og centralbanker" | R0190 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko, øvrige | R0200 | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Marginal fordeling | | | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|----------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| | | mVaR 0,05 | mVaR 0,1 | mVaR 0,2 | mVaR 0,25 | mVaR 0,3 | mVaR 0,4 | mVaR 0,5 | mVaR 0,6 | mVaR 0,7 | mVaR 0,75 |
| | | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 |
| Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2-komponenter) | R0010 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | R0020 | | | | | | | | | | |
| Markeds- og kreditrisiko — diversificering | R0030 | | | | | | | | | | |
| Individuel markedsrisiko | | | | | | | | | | | |
| Summen af renterisici | R0040 | | | | | | | | | | |
| heraf: Diversificeret renterisici | R0050 | | | | | | | | | | |
| Renterisici | R0060 | | | | | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko | R0070 | | | | | | | | | | |
| Inflationsrisiko | R0080 | | | | | | | | | | |
| Summen af aktierisici | R0090 | | | | | | | | | | |
| heraf: Summen af aktierisici diversificeret | R0100 | | | | | | | | | | |
| Aktierisici | R0110 | | | | | | | | | | |
| Aktievolatilitetsrisiko | R0120 | | | | | | | | | | |
| Ejendomsrisici | R0130 | | | | | | | | | | |

(forts.)

| | | Marginal variation | | | | | | | | |
|---|--------------|--------------------|----------|------------|-----------|------------|-----------|------------|------------|------------|
| | | mVaR 0,8 | mVaR 0,9 | mVaR 0,975 | mVaR 0,98 | mVaR 0,985 | mVaR 0,99 | mVaR 0,995 | mVaR 0,997 | mVaR 0,999 |
| | | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 |
| Summen af kreditrisici | R0150 | | | | | | | | | |
| heraf: Kreditrisici diversificeret | R0160 | | | | | | | | | |
| Kreditbegivenhedsrisici ("migration og misligholdelse") | R0170 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko | R0180 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisici "Regeringer og centralbanker" | R0190 | | | | | | | | | |
| Kreditspændsrisiko, øvrige | R0200 | | | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| Individuelle stød | | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for renter | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0210 | | | | | | |
| Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| - 100bp | R0220 | | | | | | |
| + 100bp | R0230 | | | | | | |
| - 50bp | R0240 | | | | | | |
| + 50bp | R0250 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for inflationsrater | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0260 | | | | | | |
| Inflationsrater | | | | | | | |
| - 100bp | R0270 | | | | | | |
| + 100bp | R0280 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for kreditspænd | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0290 | | | | | | |
| Spænd (ensartet forskydning — alle løbetider og aktiver) | | | | | | | |
| - 100bp | R0300 | | | | | | |
| + 100bp | R0310 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for aktieværdier | | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| referencescenario / intet stød | R0320 | | | | | | |
| Aktier (ensartet forskydning i værdier) | | | | | | | |
| - 30 % | R0330 | | | | | | |
| + 30 % | R0340 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for ejendomsrisici | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0350 | | | | | | |
| Ejendom (ensartet forskydning i værdier) | | | | | | | |
| - 30 % | R0360 | | | | | | |
| + 30 % | R0370 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for valutarisici | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0380 | | | | | | |
| Valuta (ensartet forskydning i valutakurser) | | | | | | | |
| -10 % | R0390 | | | | | | |
| + 10 % | R0400 | | | | | | |

| | | Aktiver | Forpligtelser | Aktiver minus forpligtelser | Aktiver eksklusive unit-linked | Forpligtelser eksklusive unit-linked | Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked |
|--|--------------|---------|---------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| Eksposering, der er følsom over for rentevolatilitet | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0410 | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko (ned) | | | | | | | |
| - 25 % | R0420 | | | | | | |
| - 20 basispoint for normal volatilitet | R0430 | | | | | | |
| Rentevolatilitetsrisiko (op) | | | | | | | |
| + 25 % | R0440 | | | | | | |
| + 20 basispoint for normal volatilitet | R0450 | | | | | | |
| Eksposering, der er følsom over for aktievolatilitet | | | | | | | |
| referencescenario / intet stød | R0460 | | | | | | |
| Aktievolatilitet (ned) | | | | | | | |
| - 25 % | R0470 | | | | | | |
| Aktievolatilitet (op) | | | | | | | |
| + 25 % | R0480 | | | | | | |

S.26.10.01

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed — Porteføljeoversigt

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Indvirkning på solvenskapitalkrav (koncern)

| | | Navnet på koncernens eksponering | Markeds-værdi | Eksponering ved misligholdelse | Kreditrisikobidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) |
|---|-------|----------------------------------|---------------|--------------------------------|--------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (koncernniveau) | | | | | | | | | |
| Summen af alle eksponeringer | R0010 | | | | | | | | |
| De højeste eksponeringer i alt | R0020 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 1 | R0030 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 2 | R0040 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 3 | R0050 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 4 | R0060 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 5 | R0070 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 6 | R0080 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 7 | R0090 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 8 | R0100 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 9 | R0110 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 10 | R0120 | | | | | | | | |
| Alle andre eksponeringer | R0130 | | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Indvirkning på solvenskapitalkrav (det enkelte selskab)

| | | Navnet på koncernens eksponering | Markeds-værdi | Eksponering ved misligholdelse | Kreditrisikobidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) |
|--|-------|----------------------------------|---------------|--------------------------------|--------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (enkelte eksponeringer) | | | | | | | | | |
| Summen af alle eksponeringer | R0270 | | | | | | | | |
| De højeste eksponeringer i alt | R0280 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 1 | R0290 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 2 | R0300 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 3 | R0310 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 4 | R0320 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 5 | R0330 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 6 | R0340 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 7 | R0350 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 8 | R0360 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 9 | R0370 | | | | | | | | |
| Eksponering for modpartsgruppe 10 | R0380 | | | | | | | | |
| Alle andre eksponeringer | R0390 | | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Markedsværdi (koncern)

| | | Navnet på den enkelte eksponering | Markedsværdi | Eksponering ved misligholdelse | Kreditrisikobidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) |
|--|-------|-----------------------------------|--------------|--------------------------------|--------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| | | C0090 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (koncernniveau) | | | | | | | | | |
| Summen af alle eksponeringer | R0400 | | | | | | | | |
| De højeste eksponeringer i alt | R0410 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 1 | R0420 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 2 | R0430 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 3 | R0440 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 4 | R0450 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 5 | R0460 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 6 | R0470 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 7 | R0480 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 8 | R0490 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 9 | R0500 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 10 | R0510 | | | | | | | | |
| Alle andre eksponeringer | R0520 | | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Markedsværdi (det enkelte selskab)

| | | Navnet på den enkelte eksponering | Markedsværdi | Eksponering ved misligholdelse | Kreditrisikobidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) |
|--|-------|-----------------------------------|--------------|--------------------------------|--------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| | | C0090 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (koncernniveau) | | | | | | | | | |
| Summen af alle eksponeringer | R0400 | | | | | | | | |
| De højeste eksponeringer i alt | R0410 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 1 | R0420 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 2 | R0430 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 3 | R0440 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 4 | R0450 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 5 | R0460 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 6 | R0470 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 7 | R0480 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 8 | R0490 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 9 | R0500 | | | | | | | | |
| Individuel eksponering for modpart 10 | R0510 | | | | | | | | |
| Alle andre eksponeringer | R0520 | | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Opdelt efter aktivklasse

| | | Markeds- værdi | Eksponering ved mislig- holdelse | Kreditrisiko- bidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for mislighol- delse (i %) | Gennemsnitlig tab givet mislig- holdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobi- drag (% af det samlede beløb) |
|---------------------------------|-------|-------------------|--|-------------------------|--|---|---|---|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Opdelt efter aktivklasse | | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0530 | | | | | | | |
| Dækkede obligationer | R0540 | | | | | | | |
| Statsobligationer | R0550 | | | | | | | |
| Realkreditlån | R0560 | | | | | | | |
| Aktivsikret | R0570 | | | | | | | |
| Andet | R0580 | | | | | | | |
| Kontanter | R0590 | | | | | | | |
| Tilgodehavender | R0600 | | | | | | | |
| Genforsikring og derivater | R0610 | | | | | | | |
| Kreditforsikring | R0620 | | | | | | | |
| Ikkebalanceførte og øvrige | R0630 | | | | | | | |
| I alt | R0640 | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed, porteføljeoversigt — Opdelt efter kreditkvalitetstrin

| | | Markeds-værdi | Eksponering ved misligholdelse | Kreditrisiko-bidrag | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Markedsværdi (% af det samlede beløb) | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) |
|---|-------|---------------|--------------------------------|---------------------|---|---|---------------------------------------|---|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| Opdelt efter kreditkvalitetstrin | | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 0 | R0650 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 1 | R0660 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 2 | R0670 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 3 | R0680 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 4 | R0690 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 5 | R0700 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin 6 | R0710 | | | | | | | |
| Kreditkvalitetstrin, ikke vurderet | R0720 | | | | | | | |
| I alt | R0730 | | | | | | | |

Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed — Porteføljeoversigt

| | | mVaR |
|---|-------|-------|
| | | C0100 |
| Kreditbegivenhedsrisici ("migration og misligholdelse") — 99,5 % | R0740 | |
| Forventet tab — middelværdi | R0750 | |

S.26.11.01

Intern model — Nærmere oplysninger om kreditrisici for finansielle instrumenter

Risiko ved kreditbegivenhed for finansielle instrumenter — Eksponering ved misligholdelse

| | | Kreditkvalitetstrin 0 | Kreditkvalitetstrin 1 | Kreditkvalitetstrin 2 | Kreditkvalitetstrin 3 | Kreditkvalitetstrin 4 | Kreditkvalitetstrin 5 | Kreditkvalitetstrin 6 | Kreditkvalitetstrin, ikke vurderet | I alt |
|---------------------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------------------|-------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Eksponering ved misligholdelse | | | | | | | | | | |
| Samlet eksponering ved misligholdelse | R0010 | | | | | | | | | |
| Obligationer og lån | R0020 | | | | | | | | | |
| Statsobligationer og lån | R0030 | | | | | | | | | |
| Erhvervsobligationer og lån | R0040 | | | | | | | | | |
| Andre obligationer og lån | R0050 | | | | | | | | | |
| Kontanter | R0060 | | | | | | | | | |
| Derivater | R0070 | | | | | | | | | |
| Andet | R0080 | | | | | | | | | |

Risiko ved kreditbegivenhed for finansielle instrumenter — Sandsynlighed for misligholdelse

| | | Kreditkvalitetstrin 0 | Kreditkvalitetstrin 1 | Kreditkvalitetstrin 2 | Kreditkvalitetstrin 3 | Kreditkvalitetstrin 4 | Kreditkvalitetstrin 5 | Kreditkvalitetstrin 6 | Kreditkvalitetstrin, ikke vurderet | I alt |
|---------------------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------------------|-------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Sandsynlighed for misligholdelse | | | | | | | | | | |
| Samlet eksponering ved misligholdelse | R0100 | | | | | | | | | |

| | | Kreditkvalitetstrin 0 | Kreditkvalitetstrin 1 | Kreditkvalitetstrin 2 | Kreditkvalitetstrin 3 | Kreditkvalitetstrin 4 | Kreditkvalitetstrin 5 | Kreditkvalitetstrin 6 | Kreditkvalitetstrin, ikke vurderet | I alt |
|-----------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------------------|-------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Obligationer og lån | R0110 | | | | | | | | | |
| Statsobligationer og lån | R0120 | | | | | | | | | |
| Erhvervsobligationer og lån | R0130 | | | | | | | | | |
| Andre obligationer og lån | R0140 | | | | | | | | | |
| Kontanter | R0150 | | | | | | | | | |
| Derivater | R0160 | | | | | | | | | |
| Andet | R0170 | | | | | | | | | |

| | | C0100 |
|---|-------|-------|
| Sandsynlighed for misligholdelse, anden beskrivelse | R0180 | |

Risiko ved kreditbegivenhed for finansielle instrumenter — mVaR 99,50 %

| | | mVaR 99,50 % |
|--|-------|--------------|
| | | C0110 |
| Samlet ikkediversificeret kreditrisiko | R0190 | |
| Diversifikation: kreditrisiko | R0200 | |
| Diversificeret risiko: kreditrisiko | R0210 | |

S.26.12.01

Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter

Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter — Modpartsrisiko, eksponeringer af type 1

| | | Enkeltnavnseksponering | Kode for enkeltnavnseksponering | Tab givet misligholdelse | Eksponering ved misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse |
|--|-------|------------------------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Top 10 Type 1-eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav | | | | | | |
| I alt | R0010 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 1 | R0020 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 2 | R0030 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 3 | R0040 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 4 | R0050 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 5 | R0060 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 6 | R0070 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 7 | R0080 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 8 | R0090 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 9 | R0100 | | | | | |
| Enkeltnavnseksponering 10 | R0110 | | | | | |
| Andre eksponeringer (i alt) | R0120 | | | | | |

Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter — Modpartsrisiko, eksponeringer af type 2

| | | Tab givet misligholdelse | Eksponering ved misligholdelse | Sandsynlighed for misligholdelse | Beskrivelse af eksponering |
|---|--------------|--------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------|
| | | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Type 2-eksponering med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav | | | | | |
| I alt | R0130 | | | | |
| Forsikret portefølje | R0140 | | | | |
| Mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder | R0150 | | | | |
| Andre vigtige eksponeringer 1 | R0160 | | | | |
| Andre vigtige eksponeringer 2 | R0170 | | | | |
| Andre vigtige eksponeringer 3 | R0180 | | | | |
| Andre type 2-eksponeringer (samlet) | R0190 | | | | |

Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter — mVaR 99,50 %

| | | mVaR 99,50 % |
|--|--------------|--------------|
| | | C0070 |
| Den samlede ikkediversificerede modpartsrisiko | R0200 | |
| Diversifikation: Modpartsrisici | R0210 | |
| Diversificeret risiko: Modpartsrisici | R0220 | |

S.26.13.01

Intern model — Forsikringsrisici ved skades- og NSLT-sygeforsikring

Skadesforsikring og NSLT-sygeforsikring — Risikomodeldata

| | |
|--------------------|--------------|
| Branche | Z0010 |
| Risiko-type | Z0020 |

| | | |
|--|--------------|--------------|
| | | C0010 |
| Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for præmierisici centreret? | R0010 | |
| Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for præmierisici | R0020 | |
| Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for erstatningshensættelsesrisici centreret? | R0030 | |
| Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for erstatningshensættelsesrisici | R0040 | |
| Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for katastroferisici centreret? | R0050 | |
| Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for katastroferisici | R0060 | |

| Intern branche | Branche under Solvens II | Indikator for præmierisici | Indikator for erstatningshensættelsesrisici | Andel af intern branche tildelt Solvens II-branche |
|-----------------------|---------------------------------|-----------------------------------|--|---|
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| | | | | |

Skadesforsikring og NSLT-sygeforsikring — Risikomodeldata for erstatningshensættelser (samlet)

| | | Diversificeret erstatningshensættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv katastroferisici | Solvens II-branche | Intern branche |
|---|--------------|---|--------------------|----------------|
| | | C0070 | C0080 | C0090 |
| Uden fradrag af genforsikring | | | | |
| Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | R0070 | | | |
| Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshensættelsesrisici) | R0080 | | | |
| Solvenskapitalkrav | R0090 | | | |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | | | |
| Simuleret (output) middelværdi | R0100 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R0110 | | | |
| 0,001 | R0120 | | | |
| 0,005 | R0130 | | | |
| 0,01 | R0140 | | | |
| 0,05 | R0150 | | | |
| 0,1 | R0160 | | | |
| 0,2 | R0170 | | | |
| 0,25 | R0180 | | | |
| 0,3 | R0190 | | | |
| 0,4 | R0200 | | | |

| | | Diversificeret erstatningshen- sættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv kata- stroferisici | Solvens II-bran- che | Intern branche |
|---|--------------|--|-------------------------|----------------|
| | | C0070 | C0080 | C0090 |
| 0,5 | R0210 | | | |
| 0,6 | R0220 | | | |
| 0,7 | R0230 | | | |
| 0,75 | R0240 | | | |
| 0,8 | R0250 | | | |
| 0,9 | R0260 | | | |
| 0,975 | R0270 | | | |
| 0,98 | R0280 | | | |
| 0,985 | R0290 | | | |
| 0,99 | R0300 | | | |
| 0,995 | R0310 | | | |
| 0,997 | R0320 | | | |
| 0,999 | R0330 | | | |
| Med fradrag af genforsikring | | X | X | X |
| Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | R0340 | | | |
| Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshen- sættelsesrisici) | R0350 | | | |

| | | Diversificeret erstatningshen- sættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv kata- stroferisici | Solvens II-bran- che | Intern branche |
|---|--------------|--|-------------------------|----------------|
| | | C0070 | C0080 | C0090 |
| Solvenskapitalkrav | R0360 | | | |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | X | X | X |
| Simuleret (output) middelværdi | R0370 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R0380 | | | |
| 0,001 | R0390 | | | |
| 0,005 | R0400 | | | |
| 0,01 | R0410 | | | |
| 0,05 | R0420 | | | |
| 0,1 | R0430 | | | |
| 0,2 | R0440 | | | |
| 0,25 | R0450 | | | |
| 0,3 | R0460 | | | |
| 0,4 | R0470 | | | |
| 0,5 | R0480 | | | |
| 0,6 | R0490 | | | |
| 0,7 | R0500 | | | |
| 0,75 | R0510 | | | |
| 0,8 | R0520 | | | |
| 0,9 | R0530 | | | |

| | | Diversificeret erstatningshen- sættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv kata- stroferisici | Solvens II-bran- che | Intern branche |
|-------|--------------|--|-------------------------|----------------|
| | | C0070 | C0080 | C0090 |
| 0,975 | R0540 | | | |
| 0,98 | R0550 | | | |
| 0,985 | R0560 | | | |
| 0,99 | R0570 | | | |
| 0,995 | R0580 | | | |
| 0,997 | R0590 | | | |
| 0,999 | R0600 | | | |

| | | Samlet | Solvens II-bran- che | Intern branche |
|---|--------------|--------|-------------------------|----------------|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Uden fradrag af genforsikring | | | | |
| Tegnede bruttopræmier | R0610 | | | |
| Bruttopræmieindtægter | R0620 | | | |
| De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning | R0630 | | | |
| Hensættelser for tegnede bruttopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | R0640 | | | |

| | | Samlet | Solvens II-branche | Intern branche |
|--|--------------|--------|--------------------|----------------|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | R0650 | | | |
| Solvenskapitalkrav | R0660 | | | |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | | | |
| Simuleret (output) middelværdi | R0670 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R0680 | | | |
| 0,001 | R0690 | | | |
| 0,005 | R0700 | | | |
| 0,01 | R0710 | | | |
| 0,05 | R0720 | | | |
| 0,1 | R0730 | | | |
| 0,2 | R0740 | | | |
| 0,25 | R0750 | | | |
| 0,3 | R0760 | | | |
| 0,4 | R0770 | | | |
| 0,5 | R0780 | | | |
| 0,6 | R0790 | | | |
| 0,7 | R0800 | | | |
| 0,75 | R0810 | | | |

| | | Samlet | Solvens II-branche | Intern branche |
|--|--------------|--------|--------------------|----------------|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| 0,8 | R0820 | | | |
| 0,9 | R0830 | | | |
| 0,975 | R0840 | | | |
| 0,98 | R0850 | | | |
| 0,985 | R0860 | | | |
| 0,99 | R0870 | | | |
| 0,995 | R0880 | | | |
| 0,997 | R0890 | | | |
| 0,999 | R0900 | | | |
| Med fradrag af genforsikring | | X | X | X |
| Tegnede præmier, opgjort netto | R0910 | | | |
| Indtjent nettopræmie | R0920 | | | |
| De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning | R0930 | | | |
| Hensættelser for tegnede nettopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | R0940 | | | |
| Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | R0950 | | | |
| Solvenskapitalkrav | R0960 | | | |

| | | Samlet | Solvens II-branche | Intern branche |
|--|--------------|--------|--------------------|----------------|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | | | |
| Simuleret (output) middelværdi | R0970 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R0980 | | | |
| 0,001 | R0990 | | | |
| 0,005 | R1000 | | | |
| 0,01 | R1010 | | | |
| 0,05 | R1020 | | | |
| 0,1 | R1030 | | | |
| 0,2 | R1040 | | | |
| 0,25 | R1050 | | | |
| 0,3 | R1060 | | | |
| 0,4 | R1070 | | | |
| 0,5 | R1080 | | | |
| 0,6 | R1090 | | | |
| 0,7 | R1100 | | | |
| 0,75 | R1110 | | | |
| 0,8 | R1120 | | | |
| 0,9 | R1130 | | | |
| 0,975 | R1140 | | | |

| | | Samlet | Solvens II-branche | Intern branche |
|-------|--------------|--------|--------------------|----------------|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| 0,98 | R1150 | | | |
| 0,985 | R1160 | | | |
| 0,99 | R1170 | | | |
| 0,995 | R1180 | | | |
| 0,997 | R1190 | | | |
| 0,999 | R1200 | | | |

| | | Ikkediversificerede i alt | Diversifikation | Diversificeret |
|--|--------------|---------------------------|-----------------|----------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 |
| Brutto | | | | |
| Solvenskapitalkrav | R1210 | | | |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | | | |
| Simuleret (output) middelværdi | R1220 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R1230 | | | |
| 0,001 | R1240 | | | |
| 0,005 | R1250 | | | |
| 0,01 | R1260 | | | |
| 0,05 | R1270 | | | |

| | | Ikkediversificerede i alt | Diversifikation | Diversificeret |
|-------|-------|---------------------------|-----------------|----------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 |
| 0,1 | R1280 | | | |
| 0,2 | R1290 | | | |
| 0,25 | R1300 | | | |
| 0,3 | R1310 | | | |
| 0,4 | R1320 | | | |
| 0,5 | R1330 | | | |
| 0,6 | R1340 | | | |
| 0,7 | R1350 | | | |
| 0,75 | R1360 | | | |
| 0,8 | R1370 | | | |
| 0,9 | R1380 | | | |
| 0,975 | R1390 | | | |
| 0,98 | R1400 | | | |
| 0,985 | R1410 | | | |
| 0,99 | R1420 | | | |
| 0,995 | R1430 | | | |
| 0,997 | R1440 | | | |
| 0,999 | R1450 | | | |

| | | Ikkediversificerede i alt | Diversifikation | Diversificeret |
|--|--------------|---------------------------|-----------------|----------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 |
| Med fradrag af genforsikring | | | | |
| Solvenskapitalkrav | R1460 | | | |
| Sandsynlighedsfordeling — på diskonteret basis | | | | |
| Simuleret (output) middelværdi | R1470 | | | |
| Simuleret (output) standardafvigelse | R1480 | | | |
| 0,001 | R1490 | | | |
| 0,005 | R1500 | | | |
| 0,01 | R1510 | | | |
| 0,05 | R1520 | | | |
| 0,1 | R1530 | | | |
| 0,2 | R1540 | | | |
| 0,25 | R1550 | | | |
| 0,3 | R1560 | | | |
| 0,4 | R1570 | | | |
| 0,5 | R1580 | | | |
| 0,6 | R1590 | | | |
| 0,7 | R1600 | | | |
| 0,75 | R1610 | | | |
| 0,8 | R1620 | | | |

| | | Samlet for alle risici | | | | | |
|---|--------------|------------------------|---------|------------|---------|---------|------------|
| | | Brutto | | | Netto | | |
| | | OEP tab | AEP tab | Årligt tab | OEP tab | AEP tab | Årligt tab |
| | | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 |
| Simuleret middelværdi fra modellen for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1710 | | | | | | |
| Simuleret standardafvigelse for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1720 | | | | | | |
| Simulerede percentiler for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | | | | | | | |
| 75,00 % | R1730 | | | | | | |
| 90,00 % | R1740 | | | | | | |
| 96,00 % | R1750 | | | | | | |
| 98,00 % | R1760 | | | | | | |
| 99,00 % | R1770 | | | | | | |
| 99,50 % | R1780 | | | | | | |
| 99,60 % | R1790 | | | | | | |
| 99,80 % | R1800 | | | | | | |
| 99,90 % | R1810 | | | | | | |

(forts.)

(forts.)

| | | Samlet for alle naturkatastroferisici | | | | | |
|---|--------------|---------------------------------------|---------|------------|---------|---------|------------|
| | | Brutto | | | Netto | | |
| | | OEP tab | AEP tab | Årligt tab | OEP tab | AEP tab | Årligt tab |
| | | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 |
| Simuleret middelværdi fra modellen for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1710 | | | | | | |
| Simuleret standardafvigelse for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1720 | | | | | | |
| Simulerede percentiler for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | | | | | | | |
| 75,00 % | R1730 | | | | | | |
| 90,00 % | R1740 | | | | | | |
| 96,00 % | R1750 | | | | | | |
| 98,00 % | R1760 | | | | | | |
| 99,00 % | R1770 | | | | | | |
| 99,50 % | R1780 | | | | | | |
| 99,60 % | R1790 | | | | | | |
| 99,80 % | R1800 | | | | | | |
| 99,90 % | R1810 | | | | | | |

| | | Samlet for alle menneskeskabte risici | | | | | |
|---|--------------|---------------------------------------|---------|------------|---------|---------|------------|
| | | Brutto | | | Netto | | |
| | | OEP tab | AEP tab | Årligt tab | OEP tab | AEP tab | Årligt tab |
| | | C0350 | C0360 | C0370 | C0380 | C0390 | C0400 |
| Simuleret middelværdi fra modellen for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1710 | | | | | | |
| Simuleret standardafvigelse for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | R1720 | | | | | | |
| Simulerede percentiler for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | | | | | | | |
| 75,00 % | R1730 | | | | | | |
| 90,00 % | R1740 | | | | | | |
| 96,00 % | R1750 | | | | | | |
| 98,00 % | R1760 | | | | | | |
| 99,00 % | R1770 | | | | | | |
| 99,50 % | R1780 | | | | | | |
| 99,60 % | R1790 | | | | | | |
| 99,80 % | R1800 | | | | | | |
| 99,90 % | R1810 | | | | | | |

Fordeling af tab fra katastroferisici — Data om præmier og forsikringssum

| | | Årlige brutto- præmier | Forsik- ringssum i alt |
|----------------------------|--------------|---------------------------|---------------------------|
| | | C0410 | C0420 |
| Direkte forsikring | | | |
| Europa | R1820 | | |
| Afrika | R1830 | | |
| Det nordøstlige USA | R1840 | | |
| Det sydøstlige USA | R1850 | | |
| Det midtvestlige USA | R1860 | | |
| Det vestlige USA | R1870 | | |
| Nordamerika (undtagen USA) | R1880 | | |
| Caribien & Mellemamerika | R1890 | | |
| Sydamerika | R1900 | | |
| Australien | R1910 | | |
| Japan | R1920 | | |
| Asien (undtagen Japan) | R1930 | | |
| Resten af verden | R1940 | | |
| Ikke tildelte | R1950 | | |
| Genforsikring | | | |

| | | Årlige brutto- præmier | Forsik- ringssum i alt |
|------------------|--------------|---------------------------|---------------------------|
| | | C0410 | C0420 |
| Europa | R1960 | | |
| Nordamerika | R1970 | | |
| Resten af verden | R1980 | | |
| Ikke tildelte | R1990 | | |

| | | C0430 |
|--------------------|--------------|-------|
| Direkte forsikring | R2000 | |
| Genforsikring | R2010 | |
| Retrocession | R2020 | |

| | | C0440 |
|-----------------------------|--------------|-------|
| Andre signifikante risici | R2030 | |
| Beskrivelse af andre risici | R2040 | |

| | | Solvenskapital- krav |
|---|--------------|-------------------------|
| | | C0450 |
| Samlet ikkediversificeret risiko ved naturkatastrofer | R2050 | |
| Diversifikation mellem naturkatastroferisici | R2060 | |
| Den samlede ikkediversificerede menneskeskabte risiko | R2070 | |
| Diversificering mellem menneskeskabte risici | R2080 | |
| Andre skadesforsikringskatastroferisici | R2090 | |
| Diversifikation af andre skadesforsikringskatastroferisici | R2100 | |
| Skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret i alt | R2110 | |
| De samlede skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret | R2120 | |

S.26.14.01

Intern model — Livs- og sygeforsikring

Livs- og sygeforsikringsrisici — Solvenskapitalkrav og percentiler, livsforsikring

| | |
|------------|-------|
| Risikotype | Z0010 |
|------------|-------|

| | | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Udbetalte annuiteter | Ikkeudbetalte annuiteter | Tegnede præmier, opgjort netto | Forsikringssum | Solvenskapi-talkrav |
|---------------------------------------|--------------|---|----------------------|--------------------------|--------------------------------|----------------|---------------------|
| | | C0010 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Dødelighedsrisici, i alt | R0010 | | | | | | |
| tendens | R0020 | | | | | | |
| niveau | R0030 | | | | | | |
| volatilitet | R0040 | | | | | | |
| katastrofe | R0050 | | | | | | |
| Levetidsrisici, i alt | R0060 | | | | | | |
| tendens | R0070 | | | | | | |
| niveau | R0080 | | | | | | |
| volatilitet | R0090 | | | | | | |
| katastrofe | R0100 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0110 | | | | | | |
| niveau | R0130 | | | | | | |

(forts.)

| | | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Udbetalte annuiteter | Ikkeudbetalte annuiteter | Tegnede præmier, opgjort netto | Forsikringssum | Solvenskaptalkrav |
|---|--------------|---|----------------------|--------------------------|--------------------------------|----------------|-------------------|
| | | C0010 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| volatilitet | R0140 | | | | | | |
| katastrofe | R0150 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0160 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0170 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0180 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0190 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0200 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0210 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0220 | | | | | | |
| andet | R0230 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0240 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0250 | | | | | | |
| Livsforsikring, genoptagelsesrisiko | R0260 | | | | | | |
| Kombineret dødelighedsrisici og levetidsrisici, i alt | R0270 | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0310 | | | | | | |

(forts.)

| | | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Udbetalte annuiteter | Ikkeudbetalte annuiteter | Tegnede præmier, opgjort netto | Forsikringssum | Solvenskaptalkrav |
|---|--------------|---|----------------------|--------------------------|--------------------------------|----------------|-------------------|
| | | C0010 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| tendens | R0320 | | | | | | |
| niveau | R0330 | | | | | | |
| volatilitet | R0340 | | | | | | |
| katastrofe | R0350 | | | | | | |
| Levetidsrisici | R0360 | | | | | | |
| tendens | R0370 | | | | | | |
| niveau | R0380 | | | | | | |
| volatilitet | R0390 | | | | | | |
| katastrofe | R0400 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0410 | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0420 | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0430 | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0440 | | | | | | |
| Indkomstsikring | R0450 | | | | | | |
| Invaliditetsrisici ud over udgifter til lægebehandling og indkomstsikring | R0460 | | | | | | |

(forts.)

| | | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Udbetalte annuiteter | Ikkeudbetalte annuiteter | Tegnede præmier, opgjort netto | Forsikringssum | Solvenskaptalkrav |
|--|--------------|---|----------------------|--------------------------|--------------------------------|----------------|-------------------|
| | | C0010 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 |
| Optionsrisici, i alt | R0470 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0480 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0490 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0500 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0510 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0520 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0530 | | | | | | |
| andet | R0540 | | | | | | |
| Udgiftsrisici ved SLT-sygeforsikring | R0550 | | | | | | |
| Katastroferisici ved SLT-sygeforsikring | R0560 | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici ved SLT-sygeforsikring | R0570 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0580 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0590 | | | | | | |
| Katastroferisici | R0600 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-------|
| | | Middelværdi | Standardafvigelse | 0,001 | 0,005 | 0,01 | 0,05 |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Dødelighedsrisici, i alt | R0010 | | | | | | |
| tendens | R0020 | | | | | | |
| niveau | R0030 | | | | | | |
| volatilitet | R0040 | | | | | | |
| katastrofe | R0050 | | | | | | |
| Levetidsrisici, i alt | R0060 | | | | | | |
| tendens | R0070 | | | | | | |
| niveau | R0080 | | | | | | |
| volatilitet | R0090 | | | | | | |
| katastrofe | R0100 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0110 | | | | | | |
| tendens | R0120 | | | | | | |
| niveau | R0130 | | | | | | |
| volatilitet | R0140 | | | | | | |
| katastrofe | R0150 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0160 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0170 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-------|
| | | Middelværdi | Standardafvigelse | 0,001 | 0,005 | 0,01 | 0,05 |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0180 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0190 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0200 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0210 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0220 | | | | | | |
| andet | R0230 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0240 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0250 | | | | | | |
| Livsforsikring, genoptagelsesrisiko | R0260 | | | | | | |
| Kombineret dødelighedsrisici og levetidsrisici, i alt | R0270 | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0310 | | | | | | |
| tendens | R0320 | | | | | | |
| niveau | R0330 | | | | | | |
| volatilitet | R0340 | | | | | | |
| katastrofe | R0350 | | | | | | |
| Levetidsrisici | R0360 | | | | | | |
| tendens | R0370 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-------|
| | | Middelværdi | Standardafvigelse | 0,001 | 0,005 | 0,01 | 0,05 |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 |
| niveau | R0380 | | | | | | |
| volatilitet | R0390 | | | | | | |
| katastrofe | R0400 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0410 | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0420 | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0430 | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0440 | | | | | | |
| Indkomstsikring | R0450 | | | | | | |
| Invaliditetsrisici ud over udgifter til lægebehandling og indkomstsikring | R0460 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0470 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0480 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0490 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0500 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0510 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0520 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0530 | | | | | | |
| andet | R0540 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | | (forts.) |
|--|--------------|-------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-------|----------|
| | | Middelværdi | Standardafvigelse | 0,001 | 0,005 | 0,01 | 0,05 | |
| | | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | |
| Udgiftsrisici ved SLT-sygeforsikring | R0550 | | | | | | | |
| Katastroferisici ved SLT-sygeforsikring | R0560 | | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici ved SLT-sygeforsikring | R0570 | | | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0580 | | | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0590 | | | | | | | |
| Katastroferisici | R0600 | | | | | | | |

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | | (forts.) |
|--------------------------|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| | | 0,1 | 0,2 | 0,25 | 0,3 | 0,4 | 0,5 | |
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | |
| Dødelighedsrisici, i alt | R0010 | | | | | | | |
| tendens | R0020 | | | | | | | |
| niveau | R0030 | | | | | | | |
| volatilitet | R0040 | | | | | | | |
| katastrofe | R0050 | | | | | | | |
| Levetidsrisici, i alt | R0060 | | | | | | | |
| tendens | R0070 | | | | | | | |

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,1 | 0,2 | 0,25 | 0,3 | 0,4 | 0,5 |
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| niveau | R0080 | | | | | | |
| volatilitet | R0090 | | | | | | |
| katastrofe | R0100 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0110 | | | | | | |
| tendens | R0120 | | | | | | |
| niveau | R0130 | | | | | | |
| volatilitet | R0140 | | | | | | |
| katastrofe | R0150 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0160 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0170 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0180 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0190 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0200 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0210 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0220 | | | | | | |
| andet | R0230 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0240 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,1 | 0,2 | 0,25 | 0,3 | 0,4 | 0,5 |
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0250 | | | | | | |
| Livsforsikring, genoptagelsesrisiko | R0260 | | | | | | |
| Kombineret dødelighedsrisici og levetidsrisici, i alt | R0270 | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0310 | | | | | | |
| tendens | R0320 | | | | | | |
| niveau | R0330 | | | | | | |
| volatilitet | R0340 | | | | | | |
| katastrofe | R0350 | | | | | | |
| Levetidsrisici | R0360 | | | | | | |
| tendens | R0370 | | | | | | |
| niveau | R0380 | | | | | | |
| volatilitet | R0390 | | | | | | |
| katastrofe | R0400 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0410 | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0420 | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0430 | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0440 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,1 | 0,2 | 0,25 | 0,3 | 0,4 | 0,5 |
| | | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| Indkomstsikring | R0450 | | | | | | |
| Invaliderisici ud over udgifter til lægebehandling og indkomstsikring | R0460 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0470 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0480 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0490 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0500 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0510 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0520 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0530 | | | | | | |
| andet | R0540 | | | | | | |
| Udgifterisici ved SLT-sygeforsikring | R0550 | | | | | | |
| Katastroferisici ved SLT-sygeforsikring | R0560 | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici ved SLT-sygeforsikring | R0570 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0580 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0590 | | | | | | |
| Katastroferisici | R0600 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,6 | 0,7 | 0,75 | 0,8 | 0,9 | 0,975 |
| | | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| Dødelighedsrisici, i alt | R0010 | | | | | | |
| tendens | R0020 | | | | | | |
| niveau | R0030 | | | | | | |
| volatilitet | R0040 | | | | | | |
| katastrofe | R0050 | | | | | | |
| Levetidsrisici, i alt | R0060 | | | | | | |
| tendens | R0070 | | | | | | |
| niveau | R0080 | | | | | | |
| volatilitet | R0090 | | | | | | |
| katastrofe | R0100 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0110 | | | | | | |
| tendens | R0120 | | | | | | |
| niveau | R0130 | | | | | | |
| volatilitet | R0140 | | | | | | |
| katastrofe | R0150 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0160 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0170 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,6 | 0,7 | 0,75 | 0,8 | 0,9 | 0,975 |
| | | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0180 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0190 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0200 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0210 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0220 | | | | | | |
| andet | R0230 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0240 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0250 | | | | | | |
| Livsforsikring, genoptagelsesrisiko | R0260 | | | | | | |
| Kombineret dødelighedsrisici og levetidsrisici, i alt | R0270 | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0310 | | | | | | |
| tendens | R0320 | | | | | | |
| niveau | R0330 | | | | | | |
| volatilitet | R0340 | | | | | | |
| katastrofe | R0350 | | | | | | |
| Levetidsrisici | R0360 | | | | | | |
| tendens | R0370 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,6 | 0,7 | 0,75 | 0,8 | 0,9 | 0,975 |
| | | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| niveau | R0380 | | | | | | |
| volatilitet | R0390 | | | | | | |
| katastrofe | R0400 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0410 | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0420 | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0430 | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0440 | | | | | | |
| Indkomstsikring | R0450 | | | | | | |
| Invaliditetsrisici ud over udgifter til lægebehandling og indkomstsikring | R0460 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0470 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0480 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0490 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0500 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0510 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0520 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0530 | | | | | | |
| andet | R0540 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|--|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,6 | 0,7 | 0,75 | 0,8 | 0,9 | 0,975 |
| | | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 |
| Udgiftsrisici ved SLT-sygeforsikring | R0550 | | | | | | |
| Katastroferisici ved SLT-sygeforsikring | R0560 | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici ved SLT-sygeforsikring | R0570 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0580 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0590 | | | | | | |
| Katastroferisici | R0600 | | | | | | |

(forts.)

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|--------------------------|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,98 | 0,985 | 0,99 | 0,995 | 0,997 | 0,999 |
| | | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 |
| Dødelighedsrisici, i alt | R0010 | | | | | | |
| tendens | R0020 | | | | | | |
| niveau | R0030 | | | | | | |
| volatilitet | R0040 | | | | | | |
| katastrofe | R0050 | | | | | | |
| Levetidsrisici, i alt | R0060 | | | | | | |
| tendens | R0070 | | | | | | |
| niveau | R0080 | | | | | | |

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,98 | 0,985 | 0,99 | 0,995 | 0,997 | 0,999 |
| | | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 |
| volatilitet | R0090 | | | | | | |
| katastrofe | R0100 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0110 | | | | | | |
| tendens | R0120 | | | | | | |
| niveau | R0130 | | | | | | |
| volatilitet | R0140 | | | | | | |
| katastrofe | R0150 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0160 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0170 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0180 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0190 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0200 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0210 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0220 | | | | | | |
| andet | R0230 | | | | | | |
| Omkostningsrisici for livsforsikringer | R0240 | | | | | | |
| Livsforsikringskatastroferisici | R0250 | | | | | | |

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,98 | 0,985 | 0,99 | 0,995 | 0,997 | 0,999 |
| | | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 |
| Livsforsikring, genoptagelsesrisiko | R0260 | | | | | | |
| Kombineret dødelighedsrisici og levetidsrisici, i alt | R0270 | | | | | | |
| Dødelighedsrisici | R0310 | | | | | | |
| tendens | R0320 | | | | | | |
| niveau | R0330 | | | | | | |
| volatilitet | R0340 | | | | | | |
| katastrofe | R0350 | | | | | | |
| Levetidsrisici | R0360 | | | | | | |
| tendens | R0370 | | | | | | |
| niveau | R0380 | | | | | | |
| volatilitet | R0390 | | | | | | |
| katastrofe | R0400 | | | | | | |
| Invaliditets- og sygdomsrisici, i alt | R0410 | | | | | | |
| Udgifter til lægebehandling | R0420 | | | | | | |
| Stigning i udgifter til lægebehandling | R0430 | | | | | | |
| Fald i udgifter til lægebehandling | R0440 | | | | | | |
| Indkomstsikring | R0450 | | | | | | |

| | | Sandsynlighedsfordeling | | | | | |
|---|--------------|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 0,98 | 0,985 | 0,99 | 0,995 | 0,997 | 0,999 |
| | | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 |
| Invalidetsrisici ud over udgifter til lægebehandling og indkomstsikring | R0460 | | | | | | |
| Optionsrisici, i alt | R0470 | | | | | | |
| Risici for stigning i optionsintensiteten | R0480 | | | | | | |
| Risici for fald i optionsintensiteten | R0490 | | | | | | |
| Masseoptionsrisici | R0500 | | | | | | |
| Opdeling af optionsrisici, i alt | R0510 | | | | | | |
| Fuldstændigt genkøb | R0520 | | | | | | |
| Delvis genkøb | R0530 | | | | | | |
| andet | R0540 | | | | | | |
| Udgiftsrisici ved SLT-sygeforsikring | R0550 | | | | | | |
| Katastroferisici ved SLT-sygeforsikring | R0560 | | | | | | |
| Genoptagelsesrisici ved SLT-sygeforsikring | R0570 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med tendenser | R0580 | | | | | | |
| Risici i forbindelse med niveau | R0590 | | | | | | |
| Katastroferisici | R0600 | | | | | | |

| | | Solvenskapital- krav |
|---------------------------|--------------|-------------------------|
| | | C0320 |
| Ikkediversificerede i alt | R0610 | |
| Diversifikation | R0620 | |
| Diversificeret | R0630 | |

Intern model — Solvenskapitalkrav

| | | Solvenskapi- talkrav |
|--|--------------|-------------------------|
| | | C0220 |
| Det samlede niveau 2, ikkediversificeret | R0030 | |
| Summen af diversifikation blandt poster på niveau 2 | R0040 | |
| Det samlede niveau 1, ikkediversificeret | R0050 | |
| Operationelle risici — diversifikation mellem poster på niveau 1 | R0060 | |
| Operationel risiko — diversificeret | R0070 | |

S.26.16.01

Intern model — Ændringer af modellen

Ændringer af modeller — Politik for ændring af modeller

| | Ændrings-ID | Godkendelsesdato | Indgivelsesdato | Beskrivelse af ændring af modellen |
|---------------------------------|-------------|------------------|-----------------|------------------------------------|
| | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Politik for ændring af modeller | | | | |

S.27.01.01

Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici

Anvendte forenklinger

| | | |
|---|-------|-----------------------|
| | | Anvendte forenklinger |
| | | C0001 |
| Anvendte forenklinger — brandrisici | R0001 | |
| Anvendte forenklinger — naturkatastroferisici | R0002 | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Skadesforsikringskatastroferisici — Oversigt | | X | X | X |
| Naturkatastroferisici | R0010 | | | |
| Storm | R0020 | | | |
| Jordskælv | R0030 | | | |
| Oversvømmelse | R0040 | | | |
| Hagl | R0050 | | | |
| Jordskred | R0060 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0070 | | | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsforsikring | R0080 | | | |
| Menneskeskabte katastroferisici | R0090 | | | |
| Motoransvarsforsikring | R0100 | | | |
| Søforsikring | R0110 | | | |
| Luftfartsaktiviteter | R0120 | | | |
| Brand | R0130 | | | |
| Ansvar | R0140 | | | |
| Kredit- og kaufionsforsikring. | R0150 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0160 | | | |
| Andre skadesforsikringskatastroferisici | R0170 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0180 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt før diversifikation | R0190 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0200 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt efter diversifikation | R0210 | | | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici | R0300 | | | |
| Masseulykkesrisici | R0310 | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R0320 | | | |
| Pandemirisici | R0330 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0340 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | | | | |
| Ungarn | R0461 | | | | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | | | | |
| Irland | R0480 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | | | | |
| Republikken Finland | R0521 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | | | | |
| Martinique | R0570 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | | | | |
| Réunion | R0590 | | | | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | | | | |
| Sydeuropa | R0640 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|------------------------|---|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Østasien | R0660 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | | | | |
| Oceanien | R0680 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risiko-reduktion | Skønnede genindsættelses-præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--------------------------|----------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | |
| Ungarn | R0461 | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | |
| Irland | R0480 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Republikken Finland | R0521 | | | |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | |
| Martinique | R0570 | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | |
| Réunion | R0590 | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | |
| Sydeuropa | R0640 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | |
| Østasien | R0660 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | |
| Oceanien | R0680 | | | |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksponering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor for risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|---|--|-------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Republikken Østrig | R0830 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R0860 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|---|--------------|--|--------------|------------------------|---|--|-------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Den Hellske Republik | R0920 | | | | | | |
| Ungarn | R0930 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | | | | | |
| Republikken Malta | R0950 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | | | | | |
| Rumænien | R0970 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R0990 | | | | | | |
| Guadeloupe | R1000 | | | | | | |
| Martinique | R1010 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner for diversifikation | R1030 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|---|--|-------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Nordeuropa | R1040 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1050 | | | | | | |
| Østeuropa | R1060 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1070 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | | | | | |
| Østasien | R1090 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | | | | | |
| Oceanien | R1110 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Republikken Østrig | R0830 | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | |
| Republikken Kroatien | R0860 | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | |
| Den Helleniske Republik | R0920 | | |
| Ungarn | R0930 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Republikken Malta | R0950 | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | |
| Rumænien | R0970 | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | |
| Republikken Slovenien | R0990 | | |
| Guadeloupe | R1000 | | |
| Martinique | R1010 | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1030 | | |
| Nordeuropa | R1040 | | |
| Vesteuropa | R1050 | | |
| Østeuropa | R1060 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Sydeuropa | R1070 | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | |
| Østasien | R1090 | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | |
| Oceanien | R1110 | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor for risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|-----------------------------------|-------|--|-------------|------------------------|---|--|-------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|--|--|-------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | | | | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Republikken Østrig | R1260 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | | | | |
| Ungarn | R1330 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | | | | |
| Republikken Polen | R1350 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|---|--------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Rumænien | R1360 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner for diversifikation | R1400 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | | | | |
| Østeuropa | R1430 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1440 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | | | | |
| Østasien | R1460 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor for risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|---|--------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Oceanien | R1480 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Republikken Østrig | R1260 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | |
| Ungarn | R1330 | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | |
| Republikken Polen | R1350 | | | |
| Rumænien | R1360 | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1400 | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | |
| Østeuropa | R1430 | | | |
| Sydeuropa | R1440 | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | |
| Østasien | R1460 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | |
| Oceanien | R1480 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner for diversifikation | R1590 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner for diversifikation | R1600 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1590 | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner før diversifikation | R1600 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Republikken Østrig | R1630 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|------------------------|---|--------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | | | | |
| Østeuropa | R1750 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | | | | |
| Østasien | R1780 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | | | | |
| Oceanien | R1800 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|--------------|--|--------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1910 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Hagl i alt for alle regioner før diversifikation | R1920 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Republikken Østrig | R1630 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risiko-reduktion | Skønnede genindsættelses-præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--------------------------|----------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | |
| Østeuropa | R1750 | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risiko-reduktion | Skønnede genindsættelses-præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--------------------------|----------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Østasien | R1780 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | |
| Oceanien | R1800 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1910 | | | |
| Hagl i alt for alle regioner før diversifikation | R1920 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|------------------------|--|--|-------------------------|
| | | C0390 | C0400 | C0410 | C0420 | C0430 | C0440 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | | | | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---------------------------------------|-------|---------------------------------|--|
| | | C0450 | C0460 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | |

| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | Skøn over præmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|-------|------------------------------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0470 | C0480 | C0490 | C0500 | C0510 |
| Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | R2000 | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Motoransvar | | Antal køretøjer — policegrænse over 24 mio. EUR | Antal køretøjer — policegrænse under eller lig med 24 mio. EUR | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring efter risikoreduktion |
|---|-------|---|--|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0520 | C0530 | C0540 | C0550 | C0560 | C0570 |
| Motoransvarsforsikring | R2100 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|-------|---|---|--|---|-------------------------|---------------------------------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tankskibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kaskoforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søansvarsforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion for søansvarsforsikring for olieforurening for tankskib t | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier |
| | | C0580 | C0590 | C0600 | C0610 | C0620 | C0630 |
| Tankskibskollision | R2200 | | | | | | |

(forts.)

| | | | |
|--|-------|---|----------------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tankskibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision efter risikoreduktion | Fartøjets navn |
| | | C0640 | C0650 |
| Tankskibskollision | R2200 | | |

| | | | | | | | |
|--|-------|---|---|--|--|--|---|
| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til skade på ejendom før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til fjernelse af vragester før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tab af produktionsindtægter før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til afdækning eller sikring af borehullet før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvarsforsikrings- og ansvarsfølgesforpligtelser før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion før risikoreduktion |
| | | C0660 | C0670 | C0680 | C0690 | C0700 | C0710 |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | | | |

(forts.)

| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion efter risikoreduktion | Platformens navn |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|---|------------------|
| | | C0720 | C0730 | C0740 | C0750 |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Søforsikring | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion |
|--|--------------|---|-------------------------------|---|
| | | C0760 | C0770 | C0780 |
| I alt før diversifikation | R2400 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R2410 | | X | |
| I alt efter diversifikation | R2420 | | | |

Antal fartøjer

| | | Antal |
|--|--------------|-------|
| | | C0781 |
| Antal fartøjer under tærsklen på 250 000 EUR | R2421 | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Luftfart | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartskaskoforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartsansvarsforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart efter risikoreduktion |
|---|--------------|---|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0790 | C0800 | C0810 | C0820 | C0830 | C0840 |
| Bruttokapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart | R2500 | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Brand | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0850 | C0860 | C0870 | C0880 |
| Brand | R2600 | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Højeste ydede ansvarsgrænse | Antal krav | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion |
|--|--------------|---|-----------------------------|------------|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0890 | C0900 | C0910 | C0920 | C0930 | C0940 | C0950 |
| Erhvervsansvarsforsikring | R2700 | | | | | | | |
| Arbejdsgiveransvarsforsikring | R2710 | | | | | | | |
| Bestyrelsesansvarsforsikring | R2720 | | | | | | | |
| Anden ansvarsforsikring | R2730 | | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring | R2740 | | | | | | | |
| I alt | R2750 | | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion |
|--|--------------|---|-------------------------------|---|
| | | C0960 | C0970 | C0980 |
| I alt før diversifikation | R2800 | | | |
| Diversifikation mellem dækningstyper | R2810 | | X | |
| I alt efter diversifikation | R2820 | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionrisici — Stor kreditmisligholdelse | | Eksposering (på individuelt niveau eller koncernniveau) | Andel af skade forårsaget af scenario | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse |
|--|--------------|---|---------------------------------------|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0990 | C1000 | C1010 | C1020 | C1030 | C1040 |
| Største eksposering 1 | R2900 | | | | | | |
| Største eksposering 2 | R2910 | | | | | | |
| I alt | R2920 | | | | | | |

| | | | | | | |
|--|--------------|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionsrisici — Recessionsrisici | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Recessionsrisici | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Recessionsrisici |
| | | C1050 | C1060 | C1070 | C1080 | C1090 |
| I alt | R3000 | | | | | |

| | | | | |
|---|--------------|--|-------------------------------|--|
| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit og kaution | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion |
| | | C1100 | C1110 | C1120 |
| I alt før diversifikation | R3100 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R3110 | | X | |
| I alt efter diversifikation | R3120 | | | |

| | | | | | |
|---|--------------|--|---|-------------------------------|---|
| Andre skadesforsikringskatastroferisici | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion |
| | | C1130 | C1140 | C1150 | C1160 |
| Anden transportforsikring end sø- og luftfartsforsikring | R3200 | | | X | X |
| Anden ikkeproportional transportgenforsikring end sø- og luftfartsgenforsikring | R3210 | | | X | X |
| Diverse økonomiske tab | R3220 | | | X | X |

| | | | | | |
|---|--------------|--|--|--|--|
| Ikkeproportional ulykkesgenforsikring, undtagen almindelig ansvarsgenforsikring | R3230 | | | | |
| Ikkeproportional kredit- og kautionsgenforsikring | R3240 | | | | |
| I alt før diversifikation | R3250 | | | | |
| Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | R3260 | | | | |
| I alt efter diversifikation | R3270 | | | | |

| | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|--|--------------------------|--|--------------------------|--|
| | | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|---|--------------|-------------------------------|---|--------------------------|---|--------------------------|---|
| | | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|--|--------------------------|--|--------------------------|--|
| | | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | |

(forts.)

| | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|---|-----------------------|---|----------------------|---|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | |

(forts.)

| | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|-------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelses- præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikore- duktion |
|---|-------|---|---|
| | | C1290 | C1300 |
| Republikken Østrig | R3300 | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | |
| Republikken Estland | R3370 | | |
| Republikken Finland | R3380 | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | |
| Den Helleniske Republik | R3400 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Ungarn | R3420 | | |
| Republikken Island | R3430 | | |
| Irland | R3440 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | |
| Republikken Letland | R3460 | | |
| Republikken Litauen | R3470 | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | |
| Republikken Malta | R3490 | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | |
| Republikken Polen | R3520 | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Maseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Rumænien | R3540 | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | |
| Maseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | |
| Maseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisiko-koncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|--|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R3800 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisiko-koncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|--|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 |
| Ungarn | R3820 | | | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | | | |
| Irland | R3840 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3890 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisiko-koncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|--|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 |
| Rumænien | R3940 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nord-irland | R4000 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risiko-reduktion | Skønnede genindsættelses-præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------------------|----------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3800 | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | |
| Ungarn | R3820 | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | |
| Irland | R3840 | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | |
| Republikken Malta | R3890 | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | |
| Rumænien | R3940 | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4000 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|-------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | | | |
| C1410 | | | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | | | |
| ... | | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | |
| C1410 | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | |
| ... | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisiko-koncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling | (forts.) |
|--|-------|--|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|----------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|-------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Den Helleniske Republik | R4200 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4400 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | |
|---|--------------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|-------|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | | C1480 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | |
|---|--------------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|-------|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | | C1480 |
| Den Hellske Republik | R4200 | | | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | | | |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | | | |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | |
|---|--------------|---|---|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|-------|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsstatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | | C1480 |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4400 | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|--|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | |
| ... | | | | | | | |
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | |

(forts.)

| | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | | |

S.27.01.04

Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici

Anvendte forenklinger

| | | Anvendte forenklinger |
|---|-------|-----------------------|
| | | C0001 |
| Anvendte forenklinger — brandrisici | R0001 | |
| Anvendte forenklinger — naturkatastroferisici | R0002 | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Skadesforsikringskatastroferisici — Oversigt | | | | |
| Naturkatastroferisici | R0010 | | | |
| Storm | R0020 | | | |
| Jordskælv | R0030 | | | |
| Oversvømmelse | R0040 | | | |
| Hagl | R0050 | | | |
| Jordskred | R0060 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0070 | | | |
| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | R0080 | | | |
| Menneskeskabte katastroferisici | R0090 | | | |
| Motoransvarsforsikring | R0100 | | | |
| Søforsikring | R0110 | | | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Luftfartsaktiviteter | R0120 | | | |
| Brand | R0130 | | | |
| Ansvar | R0140 | | | |
| Kredit- og kautionsforsikring | R0150 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0160 | | | |
| Andre skadesforsikringskatastroferisici | R0170 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0180 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt før diversifikation | R0190 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0200 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt efter diversifikation | R0210 | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici | R0300 | | | |
| Masseulykkesrisici | R0310 | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R0320 | | | |
| Pandemirisici | R0330 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0340 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | | | | |
| Ungarn | R0461 | | | | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | | | | |
| Irland | R0480 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Republikken Finland | R0521 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | | | | |
| Martinique | R0570 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | | | | |
| Réunion | R0590 | | | | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | | | | |
| Sydeuropa | R0640 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | | | | |
| Østasien | R0660 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | | | | |
| Oceanien | R0680 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|-------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | |
| Ungarn | R0461 | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | |
| Irland | R0480 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | |
| Republikken Finland | R0521 | | | |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | |
| Martinique | R0570 | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | |
| Réunion | R0590 | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | |
| Sydeuropa | R0640 | | | |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | |
| Østasien | R0660 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | |
| Oceanien | R0680 | | | |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | (forts.) |
|-----------------------------------|--------------|--|-------------|------------------------|--|--|-------------------------|----------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | |
| Republikken Østrig | R0830 | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Republikken Kroatien | R0860 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R0920 | | | | | | |
| Ungarn | R0930 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | | | | | |
| Republikken Malta | R0950 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | | | | | |
| Rumænien | R0970 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R0990 | | | | | | |
| Guadeloupe | R1000 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|---|--------------|--|--------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Martinique | R1010 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1030 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1040 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1050 | | | | | | |
| Østeuropa | R1060 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1070 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | | | | | |
| Østasien | R1090 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | | | | | |
| Oceanien | R1110 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Republikken Østrig | R0830 | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | |
| Republikken Kroatien | R0860 | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | |
| Den Helleniske Republik | R0920 | | |
| Ungarn | R0930 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | |
| Republikken Malta | R0950 | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | |
| Rumænien | R0970 | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | |
| Republikken Slovenien | R0990 | | |
| Guadeloupe | R1000 | | |
| Martinique | R1010 | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1030 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Nordeuropa | R1040 | | |
| Vesteuropa | R1050 | | |
| Østeuropa | R1060 | | |
| Sydeuropa | R1070 | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | |
| Østasien | R1090 | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | |
| Oceanien | R1110 | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor for risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | (forts.) |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--|-------------------------|----------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion | (forts.) |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|---|------------------------------|----------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | | | | | | |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | | | | | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | | | | | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|--------------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor for risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|----------|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | |
| Republikken Østrig | R1260 | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | | | | | |
| Ungarn | R1330 | | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Republikken Polen | R1350 | | | | | | |
| Rumænien | R1360 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1400 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | | | | |
| Østeuropa | R1430 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1440 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | | | | |
| Østasien | R1460 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | | | | |
| Oceanien | R1480 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|----------|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|-------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Republikken Østrig | R1260 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | |
| Ungarn | R1330 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | |
| Republikken Polen | R1350 | | | |
| Rumænien | R1360 | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner for diversifikation | R1400 | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | |
| Østeuropa | R1430 | | | |
| Sydeuropa | R1440 | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | |
| Østasien | R1460 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | |
| Oceanien | R1480 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto-præmier, som skal tjenes | Eksponering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko-faktor for risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|--|-------|---|-------------|------------------------|---|--------------------|--|----------|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1590 | | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner før diversifikation | R1600 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1590 | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner før diversifikation | R1600 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor for risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|--|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|----------|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | |
| Republikken Østrig | R1630 | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | | | | |
| Østeuropa | R1750 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | | | | |
| Østasien | R1780 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | | | | |
| Oceanien | R1800 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversi- fikation | R1910 | | | | | | |
| Hagl i alt for alle regioner før diversi- fikation | R1920 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Republikken Østrig | R1630 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | |
| Østeuropa | R1750 | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | |
| Østasien | R1780 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Oceanien | R1800 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1910 | | | |
| Hagl i alt for alle regioner før diversifikation | R1920 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksponering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0390 | C0400 | C0410 | C0420 | C0430 | C0440 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | | | | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|--------------------------------------|--|
| | | C0450 | C0460 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | |

| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | Skøn over præmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduk- tion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genindsættelses- præmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|---------------------------------------|---|------------------------------|---|--|
| | | C0470 | C0480 | C0490 | C0500 | C0510 |
| Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | R2000 | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Motoransvar | | Antal køretøjer — policegrænse over 24 mio. EUR | Antal køretøjer — policegrænse under eller lig med 24 mio. EUR | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsfor- sikring før risiko- reduktion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genindsættelses- præmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsfor- sikring efter risikore- duktion |
|---|--------------|---|---|--|------------------------------|---|--|
| | | C0520 | C0530 | C0540 | C0550 | C0560 | C0570 |
| Motoransvarsforsikring | R2100 | | | | | | |

| | | | | | | | | |
|---|-------|---|---|--|--|-------------------------|---------------------------------|----------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tank-skibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kaskoforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søansvarsforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion for søansvarsforsikring for olieforurening for tankskib t | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tank-skibskollision før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | (forts.) |
| | | C0580 | C0590 | C0600 | C0610 | C0620 | C0630 | |
| Tankskibskollision | R2200 | | | | | | | |

| | | | |
|--|-------|---|----------------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tankskibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision efter risikoreduktion | Fartøjets navn |
| | | C0640 | C0650 |
| Tankskibskollision | R2200 | | |

| | | | | | | | | |
|--|-------|---|---|--|--|---|---|----------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til skade på ejendom før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til fjernelse af vragester før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tab af produktionsindtægter før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til afdækning eller sikring af borehullet før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvarsforsikrings- og ansvarsngenforsikringsforpligtelser før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion før risikoreduktion | (forts.) |
| | | C0660 | C0670 | C0680 | C0690 | C0700 | C0710 | |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | | | | |

| | | | | | |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|---|------------------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion efter risikoreduktion | Platformens navn |
| | | C0720 | C0730 | C0740 | C0750 |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | |

| | | | | |
|--|--------------|---|-------------------------------|---|
| Menneskeskabte katastroferisici — Søforsikring | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion |
| | | C0760 | C0770 | C0780 |
| I alt før diversifikation | R2400 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R2410 | | | |
| I alt efter diversifikation | R2420 | | | |

Antal fartøjer

| | | |
|--|--------------|-------|
| | | Antal |
| | | C0781 |
| Antal fartøjer under tærsklen på 250 000 EUR | R2421 | |

| | | | | | | | |
|---|--------------|---|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| Menneskeskabte katastroferisici — Luftfart | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartskaskoforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartsansvarsforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart efter risikoreduktion |
| | | C0790 | C0800 | C0810 | C0820 | C0830 | C0840 |
| Bruttokapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart | R2500 | | | | | | |

| | | | | | |
|---|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| Menneskeskabte katastroferisici — Brand | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand efter risikoreduktion |
| | | C0850 | C0860 | C0870 | C0880 |
| Brand | R2600 | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Højeste ydede ansvarsgrænse | Antal krav | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risiko- reduktion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genind- sættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risi- koreduktion |
|---|--------------|---|--------------------------------|--------------|---|------------------------------|--------------------------------------|---|
| | | C0890 | C0900 | C0910 | C0920 | C0930 | C0940 | C0950 |
| Erhvervsansvarsforsikring | R2700 | | | | | | | |
| Arbejdsgiveransvarsforsikring | R2710 | | | | | | | |
| Bestyrelsesansvarsforsikring | R2720 | | | | | | | |
| Anden ansvarsforsikring | R2730 | | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring | R2740 | | | | | | | |
| I alt | R2750 | | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Kapitalkrav for katastro- ferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastro- ferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|---|----------------------------------|--|
| | | C0960 | C0970 | C0980 |
| I alt før diversifikation | R2800 | | | |
| Diversifikation mellem dækningstyper | R2810 | | | |
| I alt efter diversifikation | R2820 | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionsrisici — Stor kreditmisligholdelse | | Eksponering (på individuelt niveau eller koncernniveau) | Andel af skade forårsaget af scenarior | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse |
|---|--------------|---|--|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0990 | C1000 | C1010 | C1020 | C1030 | C1040 |
| Største eksponering 1 | R2900 | | | | | | |
| Største eksponering 2 | R2910 | | | | | | |
| I alt | R2920 | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionsrisici — Recessionsrisici | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Recessionsrisici | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Recessionsrisici |
|--|--------------|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C1050 | C1060 | C1070 | C1080 | C1090 |
| I alt | R3000 | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit og kaution | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------------------------|--|
| | | C1100 | C1110 | C1120 |
| I alt før diversifikation | R3100 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R3110 | | | |
| I alt efter diversifikation | R3120 | | | |

| Andre skadesforsikringskatastroferisici | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|---|-------------------------------|---|
| | | C1130 | C1140 | C1150 | C1160 |
| Anden transportforsikring end sø- og luftfartsforsikring | R3200 | | | | |
| Anden ikkeproportional transportgenforsikring end sø- og luftfartsgenforsikring | R3210 | | | | |
| Diverse økonomiske tab | R3220 | | | | |
| Ikkeproportional ulykkesgenforsikring, undtagen almindelig ansvarsgenforsikring | R3230 | | | | |
| Ikkeproportional kredit- og kautionsgenforsikring | R3240 | | | | |
| I alt før diversifikation | R3250 | | | | |
| Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | R3260 | | | | |
| I alt efter diversifikation | R3270 | | | | |

| | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|---|--------------------------|---|--------------------------|---|
| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|--|--------------------------|--|--------------------------|--|
| | | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales | # Forsikrings- tagere | Samlet værdi af ydelse, der skal betales |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | | |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | | |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Republikken Østrig | R3300 | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | |
| Republikken Estland | R3370 | | |
| Republikken Finland | R3380 | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | |
| Den Hellske Republik | R3400 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | |
| Ungarn | R3420 | | |
| Republikken Island | R3430 | | |
| Irland | R3440 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | |
| Republikken Letland | R3460 | | |
| Republikken Litauen | R3470 | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Republikken Malta | R3490 | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | |
| Republikken Polen | R3520 | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | |
| Rumænien | R3540 | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|---|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| | | C1310 | Gennemsnitlig forsikringssum C1320 | Gennemsnitlig forsikringssum C1330 | Gennemsnitlig forsikringssum C1340 | Gennemsnitlig forsikringssum C1350 | Gennemsnitlig forsikringssum C1360 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R3800 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | | | |
| Ungarn | R3820 | | | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | | | |
| Irland | R3840 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3890 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | | | |
| Rumænien | R3940 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4000 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3800 | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | |
| Ungarn | R3820 | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | |
| Irland | R3840 | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Malta | R3890 | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | |
| Rumænien | R3940 | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4000 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling | (forts.) |
|--|-------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|----------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 | |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | | | | |
| C1410 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | |
| C1410 | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | |
| ... | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling | (forts.) |
|--|-------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|----------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R4200 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4400 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genind- sættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduk- tion | |
|--|--------------|--|---|--|--|------------------------------|--------------------------------------|---|-------|
| | | Andel af forsik- rede, der bruger almenpraktise- rende læge | Enhedsstat- ningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsik- rede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | | C1480 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R4200 | | | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | | | |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | | | |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genind- sættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|--|--|--|--|------------------------------|--------------------------------------|---|
| | | Andel af forsik- rede, der bruger almenpraktise- rende læge | Enhederstat- ningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsik- rede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | |
| | | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbri- tannien og Nordirland | R4400 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | | (forts.) |
|--|-------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|----------|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhederstatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhederstatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge | |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 | |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhederstatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | |
| | | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|

SR.27.01.01

Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici

Anvendte forenklinger

| | | Anvendte forenklinger |
|---|-------|-----------------------|
| | | C0001 |
| Anvendte forenklinger — brandrisici | R0001 | |
| Anvendte forenklinger — naturkatastroferisici | R0002 | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Skadesforsikringskatastroferisici — Oversigt | | | | |
| Naturkatastroferisici | R0010 | | | |
| Storm | R0020 | | | |
| Jordskælv | R0030 | | | |
| Oversvømmelse | R0040 | | | |
| Hagl | R0050 | | | |
| Jordskred | R0060 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0070 | | | |
| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | R0080 | | | |
| Menneskeskabte katastroferisici | R0090 | | | |
| Motoransvarsforsikring | R0100 | | | |

| Skades- og sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion | Risikoreduktion i alt | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-----------------------|--|
| | | C0010 | C0020 | C0030 |
| Søforsikring | R0110 | | | |
| Luftfartsaktiviteter | R0120 | | | |
| Brand | R0130 | | | |
| Ansvar | R0140 | | | |
| Kredit- og kautionsforsikring. | R0150 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0160 | | | |
| Andre skadesforsikringskatastroferisici | R0170 | | | |
| Diversifikation mellem risici | R0180 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt før diversifikation | R0190 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0200 | | | |
| Skadesforsikringskatastroferisici i alt efter diversifikation | R0210 | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici | R0300 | | | |
| Masseulykkesrisici | R0310 | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici | R0320 | | | |
| Pandemirisici | R0330 | | | |
| Diversifikation mellem delmoduler | R0340 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | | | | |
| Ungarn | R0461 | | | | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | | | | |
| Irland | R0480 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | | | | |
| Republikken Finland | R0521 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | | | | |
| Martinique | R0570 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | | | | |
| Réunion | R0590 | | | | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | | | | |
| Sydeuropa | R0640 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | | | | |
| Østasien | R0660 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Oceanien | R0680 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|-------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Republikken Østrig | R0400 | | | |
| Kongeriget Belgien | R0410 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0420 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0430 | | | |
| Kongeriget Danmark | R0440 | | | |
| Republikken Slovenien | R0441 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0450 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0460 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Ungarn | R0461 | | | |
| Republikken Island | R0470 | | | |
| Irland | R0480 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R0490 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R0500 | | | |
| Kongeriget Norge | R0510 | | | |
| Republikken Polen | R0520 | | | |
| Republikken Finland | R0521 | | | |
| Kongeriget Spanien | R0530 | | | |
| Kongeriget Sverige | R0540 | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R0550 | | | |
| Guadeloupe | R0560 | | | |
| Martinique | R0570 | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R0580 | | | |
| Réunion | R0590 | | | |
| Storm i alt for specificerede regioner før diversifikation | R0600 | | | |
| Nordeuropa | R0610 | | | |
| Vesteuropa | R0620 | | | |
| Østeuropa | R0630 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Sydeuropa | R0640 | | | |
| Central- og Vestasien | R0650 | | | |
| Østasien | R0660 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R0670 | | | |
| Oceanien | R0680 | | | |
| Det nordlige Afrika | R0690 | | | |
| Det sydlige Afrika | R0700 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R0710 | | | |

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Storm | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0100 | C0110 | C0120 |
| Caribien og Centralamerika | R0720 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R0730 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R0740 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R0750 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R0760 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R0770 | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R0780 | | | |
| Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | R0790 | | | |
| Storm i alt for alle regioner før diversifikation | R0800 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R0810 | | | |
| Storm i alt efter diversifikation | R0820 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Republikken Østrig | R0830 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R0860 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R0920 | | | | | | |
| Ungarn | R0930 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | | | | | |
| Republikken Malta | R0950 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | | | | | |
| Rumænien | R0970 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|---|--------------|--|-------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Republikken Slovenien | R0990 | | | | | | |
| Guadeloupe | R1000 | | | | | | |
| Martinique | R1010 | | | | | | |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1030 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1040 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1050 | | | | | | |
| Østeuropa | R1060 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1070 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | | | | | |
| Østasien | R1090 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | | | | | |
| Oceanien | R1110 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Republikken Østrig | R0830 | | |
| Kongeriget Belgien | R0840 | | |
| Republikken Bulgarien | R0850 | | |
| Republikken Kroatien | R0860 | | |
| Republikken Cypern | R0870 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R0880 | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R0890 | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R0900 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R0910 | | |
| Den Helleniske Republik | R0920 | | |
| Ungarn | R0930 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R0940 | | |
| Republikken Malta | R0950 | | |
| Den Portugisiske Republik | R0960 | | |
| Rumænien | R0970 | | |
| Den Slovakiske Republik | R0980 | | |
| Republikken Slovenien | R0990 | | |
| Guadeloupe | R1000 | | |
| Martinique | R1010 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Det Oversøiske Område Saint-Martin | R1020 | | |
| Jordskælv i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1030 | | |
| Nordeuropa | R1040 | | |
| Vesteuropa | R1050 | | |
| Østeuropa | R1060 | | |
| Sydeuropa | R1070 | | |
| Central- og Vestasien | R1080 | | |
| Østasien | R1090 | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1100 | | |
| Oceanien | R1110 | | |
| Det nordlige Afrika | R1120 | | |
| Det sydlige Afrika | R1130 | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1140 | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Kapitalkrav for katastrofe- risici før risi- koreduktion | Skønnet risikore- duktion |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|---|------------------------------|
| | | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | | | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | | | | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | | | | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---------------------------------|--|
| | | C0190 | C0200 |
| Caribien og Centralamerika | R1150 | | |
| Det østlige Sydamerika | R1160 | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1170 | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1180 | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1190 | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1200 | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1210 | | |
| Jordskælv i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1220 | | |
| Jordskælv i alt for alle regioner før diversifikation | R1230 | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1240 | | |
| Jordskælv i alt efter diversifikation | R1250 | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|---------------------------------------|-------|--|-------------|------------------------|--|--------------------|--|----------|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | |
| Republikken Østrig | R1260 | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | | | | |
| Ungarn | R1330 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | | | | |
| Republikken Polen | R1350 | | | | | | |
| Rumænien | R1360 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1400 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor før risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Østeuropa | R1430 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1440 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | | | | |
| Østasien | R1460 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | | | | |
| Oceanien | R1480 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Republikken Østrig | R1260 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1270 | | | |
| Republikken Bulgarien | R1280 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1290 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1300 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1310 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1320 | | | |
| Ungarn | R1330 | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1340 | | | |
| Republikken Polen | R1350 | | | |
| Rumænien | R1360 | | | |
| Den Slovakiske Republik | R1370 | | | |
| Republikken Slovenien | R1380 | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R1390 | | | |
| Oversvømmelse i alt for specificerede regioner for diversifikation | R1400 | | | |
| Nordeuropa | R1410 | | | |
| Vesteuropa | R1420 | | | |
| Østeuropa | R1430 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Sydeuropa | R1440 | | | |
| Central- og Vestasien | R1450 | | | |
| Østasien | R1460 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1470 | | | |
| Oceanien | R1480 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1490 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1500 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1510 | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1520 | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1530 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1540 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1550 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1560 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1570 | | | |

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1590 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner før diversifikation | R1600 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|-------|-------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0270 | C0280 | C0290 |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1580 | | | |
| Oversvømmelse i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1590 | | | |
| Oversvømmelse i alt for alle regioner før diversifikation | R1600 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1610 | | | |
| Oversvømmelse i alt efter diversifikation | R1620 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Republikken Østrig | R1630 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint- Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------|---------------------------|--|-----------------------|--|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 |
| Østeuropa | R1750 | | | | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | | | | |
| Østasien | R1780 | | | | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | | | | |
| Oceanien | R1800 | | | | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | | | | |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | | | | |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | | | | |

(forts.)

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skøn over brutto- præmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisiko- faktor for risikore- duktion | Scenario A eller B | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | (forts.) |
|---|--------------|--|--------------|---------------------------|--|-----------------------|--|----------|
| | | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | | | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1910 | | | | | | | |
| Hagl i alt for alle regioner før diversifikation | R1920 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | | | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættel- sespræmier | Kapitalkrav for katastro- ferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|-------------------------|--------------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Republikken Østrig | R1630 | | | |
| Kongeriget Belgien | R1640 | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R1641 | | | |
| Det Schweiziske Forbund, Fyrstendømmet Liechtenstein | R1650 | | | |
| Den franske Republik [undtagen Guadeloupe, Martinique, Det Oversøiske Område Saint-Martin og Réunion], Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R1660 | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R1670 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R1680 | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R1690 | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R1700 | | | |
| Republikken Slovenien | R1701 | | | |
| Kongeriget Spanien | R1710 | | | |
| Hagl i alt for specificerede regioner før diversifikation | R1720 | | | |
| Nordeuropa | R1730 | | | |
| Vesteuropa | R1740 | | | |
| Østeuropa | R1750 | | | |
| Sydeuropa | R1760 | | | |
| Central- og Vestasien | R1770 | | | |
| Østasien | R1780 | | | |
| Syd- og Sydøstasien | R1790 | | | |
| Oceanien | R1800 | | | |
| Det nordlige Afrika | R1810 | | | |
| Det sydlige Afrika | R1820 | | | |
| Nordamerika bortset fra Amerikas Forenede Stater | R1830 | | | |
| Caribien og Centralamerika | R1840 | | | |

| Naturkatastroferisici — Hagl | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0360 | C0370 | C0380 |
| Det østlige Sydamerika | R1850 | | | |
| Det nordlige, sydlige og vestlige Sydamerika | R1860 | | | |
| Det nordøstlige Amerikas Forenede Stater | R1870 | | | |
| Det sydøstlige Amerikas Forenede Stater | R1880 | | | |
| Det midtvestlige Amerikas Forenede Stater | R1890 | | | |
| Det vestlige Amerikas Forenede Stater | R1900 | | | |
| Hagl i alt for øvrige regioner før diversifikation | R1910 | | | |
| Hagl i alt for alle regioner før diversifikation | R1920 | | | |
| Diversifikationseffekt mellem regioner | R1930 | | | |
| Hagl i alt efter diversifikation | R1940 | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Eksposering | Specificeret bruttotab | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------|------------------------|--|--|-------------------------|
| | | C0390 | C0400 | C0410 | C0420 | C0430 | C0440 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | | | | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | | | | | |

| Naturkatastroferisici — Jordskred | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---------------------------------------|-------|---------------------------------|--|
| | | C0450 | C0460 |
| Jordskred i alt før diversifikation | R1950 | | |
| Diversifikationseffekt mellem zoner | R1960 | | |
| Jordskred i alt efter diversifikation | R1970 | | |

| Katastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | Skøn over præmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|---|-------|------------------------------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0470 | C0480 | C0490 | C0500 | C0510 |
| Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | R2000 | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Motoransvar | | Antal køretøjer — policegrænse over 24 mio. EUR | Antal køretøjer — policegrænse under eller lig med 24 mio. EUR | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring efter risikoreduktion |
|---|-------|---|--|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0520 | C0530 | C0540 | C0550 | C0560 | C0570 |
| Motoransvarsforsikring | R2100 | | | | | | |

| | | | | | | | | |
|--|-------|---|---|--|---|-------------------------|---------------------------------|----------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tankskibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kaskoforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søansvarsforsikring for tankskib t før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion for søansvarsforsikring for olieforurening for tankskib t | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindtættelsespræmier | (forts.) |
| | | C0580 | C0590 | C0600 | C0610 | C0620 | C0630 | |
| Tankskibskollision | R2200 | | | | | | | |

| | | | |
|--|-------|---|----------------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Tankskibskollision | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision efter risikoreduktion | Fartøjets navn |
| | | C0640 | C0650 |
| Tankskibskollision | R2200 | | |

| | | | | | | | | |
|--|-------|---|---|--|--|--|---|----------|
| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til skade på ejendom før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til fjernelse af vragester før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tab af produktionsindtægter før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til afdækning eller sikring af borehullet før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvarsforsikrings- og ansvarsfølpligtelser før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion før risikoreduktion | (forts.) |
| | | C0660 | C0670 | C0680 | C0690 | C0700 | C0710 | |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion | | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion efter risikoreduktion | Platformens navn |
|--|-------|-------------------------|---------------------------------|---|------------------|
| | | C0720 | C0730 | C0740 | C0750 |
| Offshoreplatformsekspllosion | R2300 | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Søforsikring | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion |
|--|-------|---|-------------------------------|---|
| | | C0760 | C0770 | C0780 |
| I alt før diversifikation | R2400 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R2410 | | | |
| I alt efter diversifikation | R2420 | | | |

Antal fartøjer

| | | Antal |
|--|-------|-------|
| | | C0781 |
| Antal fartøjer under tærsklen på 250 000 EUR | R2421 | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Luftfart | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartskaskoforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfartsansvarsforsikring før risikoreduktion | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart efter risikoreduktion |
|---|--------------|---|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C0790 | C0800 | C0810 | C0820 | C0830 | C0840 |
| Bruttokapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart | R2500 | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Brand | | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand efter risikoreduktion |
|---|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | | C0850 | C0860 | C0870 | C0880 |
| Brand | | R2600 | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Højeste ydede ansvars- grænse | Antal krav | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikore- duktion | Skønnet risi- koreduktion | Skønnede genindsættelses- præmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risi- koreduktion |
|--|--------------|---|--|--------------|---|------------------------------|---|---|
| | | C0890 | C0900 | C0910 | C0920 | C0930 | C0940 | C0950 |
| Erhvervsansvarsforsikring | R2700 | | | | | | | |
| Arbejdsgiveransvarsforsikring | R2710 | | | | | | | |
| Bestyrelsesansvarsforsikring | R2720 | | | | | | | |
| Anden ansvarsforsikring | R2730 | | | | | | | |
| Ikkeproportional genforsikring | R2740 | | | | | | | |
| I alt | R2750 | | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | Kapitalkrav for katastro- ferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastro- ferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|---|----------------------------------|--|
| | | C0960 | C0970 | C0980 |
| I alt før diversifikation | R2800 | | | |
| Diversifikation mellem dækningstyper | R2810 | | | |
| I alt efter diversifikation | R2820 | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionsrisici — Stor kreditmisligholdelse | | Eksponering (på individuelt niveau eller koncernniveau) | Andel af skade forårsaget af scenarior | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse |
|---|--------------|---|--|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C0990 | C1000 | C1010 | C1020 | C1030 | C1040 |
| Største eksponering 1 | R2900 | | | | | | |
| Største eksponering 2 | R2910 | | | | | | |
| I alt | R2920 | | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit- og kautionsrisici — Recessionsrisici | | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Recessionsrisici | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Recessionsrisici |
|--|--------------|---|---|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | C1050 | C1060 | C1070 | C1080 | C1090 |
| I alt | R3000 | | | | | |

| Menneskeskabte katastroferisici — Kredit og kaution | | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|-------------------------------|--|
| | | C1100 | C1110 | C1120 |
| I alt før diversifikation | R3100 | | | |
| Diversifikation mellem begivenhedstyper | R3110 | | | |
| I alt efter diversifikation | R3120 | | | |

| Andre skadesforsikringskatastroferisici | | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion i alt | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion |
|---|--------------|--|---|-------------------------------|---|
| | | C1130 | C1140 | C1150 | C1160 |
| Anden transportforsikring end sø- og luftfartsforsikring | R3200 | | | | |
| Anden ikkeproportional transportgenforsikring end sø- og luftfartsgenforsikring | R3210 | | | | |
| Diverse økonomiske tab | R3220 | | | | |
| Ikkeproportional ulykkesgenforsikring, undtagen almindelig ansvarsgenforsikring | R3230 | | | | |
| Ikkeproportional kredit- og kautionsgenforsikring | R3240 | | | | |
| I alt før diversifikation | R3250 | | | | |
| Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | R3260 | | | | |
| I alt efter diversifikation | R3270 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | |
|--|--------------|-------------------------------|---|-----------------------|---|----------------------|---|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Dødsfald forårsaget af ulykke | | Permanent invaliditet | | Invaliditet 10 år | | (forts.) |
|--|--------------|-------------------------------|---|-----------------------|---|----------------------|---|----------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | |
| | | C1170 | C1180 | C1190 | C1200 | C1210 | C1220 | |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Republikken Østrig | R3300 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3310 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3320 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3330 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3340 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3350 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3360 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3370 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3380 | | | | | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R3390 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3400 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3410 | | | | | | |
| Ungarn | R3420 | | | | | | |
| Republikken Island | R3430 | | | | | | |
| Irland | R3440 | | | | | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R3450 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3460 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Invaliditet 12 måneder | | Lægebehandling | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion |
|--|--------------|------------------------|---|----------------------|---|--|-------------------------|
| | | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | # Forsikrings-tagere | Samlet værdi af ydelser, der skal betales | | |
| | | C1230 | C1240 | C1250 | C1260 | C1270 | C1280 |
| Republikken Litauen | R3470 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3480 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3490 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3500 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3510 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3520 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3530 | | | | | | |
| Rumænien | R3540 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3550 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3560 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3570 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3580 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3590 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R3600 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R3610 | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R3620 | | | | | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R3630 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Republikken Østrig | R 3300 | | |
| Kongeriget Belgien | R 3310 | | |
| Republikken Bulgarien | R 3320 | | |
| Republikken Kroatien | R 3330 | | |
| Republikken Cypern | R 3340 | | |
| Den Tjekkiske Republik | R 3350 | | |
| Kongeriget Danmark | R 3360 | | |
| Republikken Estland | R 3370 | | |
| Republikken Finland | R 3380 | | |
| Den Franske Republik Fyrstendømmet Monaco, Fyrstendømmet Andorra | R 3390 | | |
| Den Hellske Republik | R 3400 | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R 3410 | | |
| Ungarn | R 3420 | | |
| Republikken Island | R 3430 | | |
| Irland | R 3440 | | |
| Den Italienske Republik, Republikken San Marino, Vatikanstaten | R 3450 | | |
| Republikken Letland | R 3460 | | |
| Republikken Litauen | R 3470 | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R 3480 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|---------------|---------------------------------|--|
| | | C1290 | C1300 |
| Republikken Malta | R 3490 | | |
| Kongeriget Nederlandene | R 3500 | | |
| Kongeriget Norge | R 3510 | | |
| Republikken Polen | R 3520 | | |
| Den Portugisiske Republik | R 3530 | | |
| Rumænien | R 3540 | | |
| Den Slovakiske Republik | R 3550 | | |
| Republikken Slovenien | R 3560 | | |
| Kongeriget Spanien | R 3570 | | |
| Kongeriget Sverige | R 3580 | | |
| Det Schweiziske Forbund | R 3590 | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R 3600 | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R 3610 | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R 3620 | | |
| Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R 3630 | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|---|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| | | C1310 | Gennemsnitlig forsikringssum C1320 | Gennemsnitlig forsikringssum C1330 | Gennemsnitlig forsikringssum C1340 | Gennemsnitlig forsikringssum C1350 | Gennemsnitlig forsikringssum C1360 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | | | |
| Den Hellske Republik | R3800 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | | | |
| Ungarn | R3820 | | | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | | | |
| Irland | R3840 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | | | |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling |
|--|--------------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | | | |
| Republikken Malta | R3890 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | | | |
| Rumænien | R3940 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4000 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Republikken Østrig | R3700 | | | | |
| Kongeriget Belgien | R3710 | | | | |
| Republikken Bulgarien | R3720 | | | | |
| Republikken Kroatien | R3730 | | | | |
| Republikken Cypern | R3740 | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R3750 | | | | |
| Kongeriget Danmark | R3760 | | | | |
| Republikken Estland | R3770 | | | | |
| Republikken Finland | R3780 | | | | |
| Den Franske Republik | R3790 | | | | |
| Den Helleniske Republik | R3800 | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R3810 | | | | |
| Ungarn | R3820 | | | | |
| Republikken Island | R3830 | | | | |
| Irland | R3840 | | | | |
| Den Italienske Republik | R3850 | | | | |
| Republikken Letland | R3860 | | | | |
| Republikken Litauen | R3870 | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R3880 | | | | |
| Republikken Malta | R3890 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|--------------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Kongeriget Nederlandene | R3900 | | | | |
| Kongeriget Norge | R3910 | | | | |
| Republikken Polen | R3920 | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R3930 | | | | |
| Rumænien | R3940 | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R3950 | | | | |
| Republikken Slovenien | R3960 | | | | |
| Kongeriget Spanien | R3970 | | | | |
| Kongeriget Sverige | R3980 | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R3990 | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4000 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling | (forts.) |
|--|-------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|----------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 | |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | | | | |
| C1410 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | | | | | |
| C1410 | | | | | |
| Land 1 | R4010 | | | | |
| ... | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Største kendte ulykkesrisikokoncentration | Dødsfald forårsaget af ulykke | Permanent invaliditet | Invaliditet 10 år | Invaliditet 12 måneder | Lægebehandling | (forts.) |
|--|-------|---|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|----------|
| | | | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | Gennemsnitlig forsikringssum | |
| | | C1310 | C1320 | C1330 | C1340 | C1350 | C1360 | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | C1370 | C1380 | C1390 | C1400 |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande før diversifikation | R4020 | | | | |
| Diversifikationseffekt mellem lande | R4030 | | | | |
| Ulykkeskoncentrationsrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | R4040 | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R4200 | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | |
|---|--------------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritannien og Nordirland | R4400 | | | | | | |

(forts.)

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | |
|---|--------------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|-------|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | | C1480 |
| Republikken Østrig | R4100 | | | | | | | | |
| Kongeriget Belgien | R4110 | | | | | | | | |
| Republikken Bulgarien | R4120 | | | | | | | | |
| Republikken Kroatien | R4130 | | | | | | | | |
| Republikken Cypern | R4140 | | | | | | | | |
| Den Tjekkiske Republik | R4150 | | | | | | | | |
| Kongeriget Danmark | R4160 | | | | | | | | |
| Republikken Estland | R4170 | | | | | | | | |
| Republikken Finland | R4180 | | | | | | | | |
| Den Franske Republik | R4190 | | | | | | | | |
| Den Helleniske Republik | R4200 | | | | | | | | |
| Forbundsrepublikken Tyskland | R4210 | | | | | | | | |
| Ungarn | R4220 | | | | | | | | |
| Republikken Island | R4230 | | | | | | | | |
| Irland | R4240 | | | | | | | | |
| Den Italienske Republik | R4250 | | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemi- risisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikore- duktion | Skønnede genind- sættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduk- tion |
|--|--------------|--|--|---|--|------------------------------|--------------------------------------|---|
| | | Andel af forsik- rede, der bruger almenpraktise- rende læge | Enhedsstat- ningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behand- ling | Andel af forsik- rede, der bruger ingen formel lægelig behand- ling | | | | |
| | | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 |
| Republikken Letland | R4260 | | | | | | | |
| Republikken Litauen | R4270 | | | | | | | |
| Storhertugdømmet Luxembourg | R4280 | | | | | | | |
| Republikken Malta | R4290 | | | | | | | |
| Kongeriget Nederlandene | R4300 | | | | | | | |
| Kongeriget Norge | R4310 | | | | | | | |
| Republikken Polen | R4320 | | | | | | | |
| Den Portugisiske Republik | R4330 | | | | | | | |
| Rumænien | R4340 | | | | | | | |
| Den Slovakiske Republik | R4350 | | | | | | | |
| Republikken Slovenien | R4360 | | | | | | | |
| Kongeriget Spanien | R4370 | | | | | | | |
| Kongeriget Sverige | R4380 | | | | | | | |
| Det Schweiziske Forbund | R4390 | | | | | | | |
| Det Forenede Kongerige Storbritan- nien og Nordirland | R4400 | | | | | | | |

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Indkomstsikring | | Udgifter til lægebehandling | | | | (forts.) |
|--|-------|------------------|---------------------------------------|-----------------------------|---|--|--|----------|
| | | Antal forsikrede | Samlet eksponering vedrørende pandemi | Antal forsikrede | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med hospitalsindlæggelse | Andel af forsikrede, der bruger hospitalsindlæggelse | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med almenpraktiserende læge | |
| | | C1420 | C1430 | C1440 | C1450 | C1460 | C1470 | |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|

| Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici | | Udgifter til lægebehandling | | | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Skønnet risikoreduktion | Skønnede genindsættelsespræmier | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion |
|--|-------|---|--|---|--|-------------------------|---------------------------------|--|
| | | Andel af forsikrede, der bruger almenpraktiserende læge | Enhedsersatningsudgifter i forbindelse med ingen formel lægelig behandling | Andel af forsikrede, der bruger ingen formel lægelig behandling | | | | |
| | | C1480 | C1490 | C1500 | C1510 | C1520 | C1530 | C1540 |
| Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | | | | | | | | |
| C1550 | | | | | | | | |
| Land 1 | R4410 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|
| Pandemi i alt for alle lande | R4420 | | | | | | |
|------------------------------|-------|--|--|--|--|--|--|

S.28.01.01

Minimumskapitalkrav — Udelukkende livsforsikrings- eller livsgenforsikringsvirksomhed eller udelukkende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksomhed**Lineært formelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser**

| | | C0010 | |
|--|-------|--|--|
| MCR _{NL} Result | R0010 | | |
| | | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) |
| | | C0020 | C0030 |
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, herunder proportional genforsikring | R0020 | | |
| Forsikring vedrørende indkomstsikring, herunder proportional genforsikring | R0030 | | |
| Arbejdsskadeforsikring, herunder proportional genforsikring | R0040 | | |
| Motoransvarsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0050 | | |
| Anden motorforsikring, herunder proportional genforsikring | R0060 | | |
| Sø-, luftfarts- og transportforsikring, herunder proportional genforsikring | R0070 | | |
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom, herunder proportional genforsikring | R0080 | | |
| Almindelig ansvarsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0090 | | |
| Kredit- og kaufionsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0100 | | |
| Retshjælpforsikring, herunder proportional genforsikring | R0110 | | |
| Assistance, herunder proportional genforsikring | R0120 | | |
| Forsikring mod diverse økonomiske tab, herunder proportional genforsikring | R0130 | | |
| Ikkeproportional sygegenforsikring | R0140 | | |
| Ikkeproportional ulykkesgenforsikring | R0150 | | |
| Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring | R0160 | | |
| Ikkeproportional ejendomsforsikring | R0170 | | |

Lineært formelelement for livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser

| | | C0040 | |
|---|-------|--|--|
| MCR _L Result | R0200 | | |
| | | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) |
| | | C0050 | C0060 |
| Forpligtelser med gevinstandele — Garanterede ydelser | R0210 | | |
| Forpligtelser med gevinstandele — Fremtidige diskretionære ydelser | R0220 | | |
| Forpligtelser i tilknytning til indeksreguleret og unit-linked forsikring | R0230 | | |
| Andre livs- og sygeforsikringsforpligtelser og livs- og sygegenforsikringsforpligtelser | R0240 | | |
| Risikosum i alt for alle livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser | R0250 | | |

Beregning af det samlede minimumskapitalkrav

| | | C0070 |
|--|--------------|-------|
| Lineært minimumskapitalkrav | R0300 | |
| Solvenskapitalkrav | R0310 | |
| Loft for minimumskapitalkrav | R0320 | |
| Bundgrænse for minimumskapitalkrav | R0330 | |
| Kombineret minimumskapitalkrav | R0340 | |
| Absolut bundgrænse for minimumskapitalkrav | R0350 | |
| | | C0070 |
| Minimumskapitalkrav | R0400 | |

S.28.02.01

Minimumskapitalkrav — Både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed

| | Skadesforsikringsvirksomhed | Livsforsikringsvirksomhed |
|--|-------------------------------|------------------------------|
| | MCR _(NL,NL) Result | MCR _(NL,L) Result |
| | C0010 | C0020 |
| Lineært formelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser | R0010 | |

Skadesforsikringsvirksomhed

Livsforsikringsvirksomhed

| | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) |
|--|--|--|--|--|
| | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, herunder proportional genforsikring | R0020 | | | |
| Forsikring vedrørende indkomstsikring, herunder proportional genforsikring | R0030 | | | |
| Arbejdsskadeforsikring, herunder proportional genforsikring | R0040 | | | |
| Motoransvarsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0050 | | | |
| Anden motorforsikring, herunder proportional genforsikring | R0060 | | | |
| Sø-, luftfarts- og transportforsikring, herunder proportional genforsikring | R0070 | | | |
| Forsikring mod brand og andre skader på ejendom, herunder proportional genforsikring | R0080 | | | |
| Almindelig ansvarsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0090 | | | |
| Kredit- og kautionsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0100 | | | |
| Retshjælpsforsikring, herunder proportional genforsikring | R0110 | | | |

Assistance, herunder proportional genforsikring

Forsikring mod diverse økonomiske tab, herunder proportional genforsikring

Ikkeproportional sygegenforsikring

Ikkeproportional ulykkesgenforsikring

Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring

Ikkeproportional ejendomsgenforsikring

| | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) |
|--------------|--|--|--|--|
| | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 |
| R0120 | | | | |
| R0130 | | | | |
| R0140 | | | | |
| R0150 | | | | |
| R0160 | | | | |
| R0170 | | | | |

| | Skadesforsikringsvirksomhed | Livsforsikringsvirksomhed |
|--------------|------------------------------|-----------------------------|
| | MCR _(L,NL) Result | MCR _(L,L) Result |
| | C0070 | C0080 |
| R0200 | | |

Lineært formelement for livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser

Forpligtelser med gevinstandele — Garanterede ydelser

Forpligtelser med gevinstandele — Fremtidige diskretionære ydelser

Forpligtelser i tilknytning til indeksreguleret og unit-linked forsikring

| | Skadesforsikringsvirksomhed | Livsforsikringsvirksomhed | | |
|--------------|--|--|--|--|
| | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) |
| | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 |
| R0210 | | | | |
| R0220 | | | | |
| R0230 | | | | |

Andre livs- og sygeforsikringsforpligtelser og livs- og sygegenforsikringsforpligtelser
Risikosum i alt for alle livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser

| | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) |
|--------------|--|--|--|--|
| | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 |
| R0240 | | | | |
| R0250 | | | | |

Beregning af det samlede minimumskapitalkrav

| | |
|--|--------------|
| | C0130 |
| Lineært minimumskapitalkrav | R0300 |
| Solvenskapitalkrav | R0310 |
| Loft for minimumskapitalkrav | R0320 |
| Bundgrænse for minimumskapitalkrav | R0330 |
| Kombineret minimumskapitalkrav | R0340 |
| Absolut bundgrænse for minimumskapitalkrav | R0350 |
| | C0130 |
| Minimumskapitalkrav | R0400 |

| Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring | Skadesforsikringsvirksomhed | Livsforsikringsvirksomhed |
|--|-----------------------------|---------------------------|
| | C0140 | C0150 |
| Teoretisk lineært minimumskapitalkrav | R0500 | |
| Teoretisk solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg (for året eller seneste beregning) | R0510 | |
| Loft for teoretisk minimumskapitalkrav | R0520 | |
| Bundgrænse for teoretisk minimumskapitalkrav | R0530 | |
| Teoretisk kombineret minimumskapitalkrav | R0540 | |
| Absolut bundgrænse for teoretisk minimumskapitalkrav | R0550 | |
| Teoretisk minimumskapitalkrav | R0560 | |

S.29.01.01

Overskydende aktiver i forhold til passiver

Afstemning med kapitalgrundlaget — Elementer indberettet under "Kapitalgrundlag"

| | År N | År N-1 | Ændring |
|--|--------------|--------|---------|
| | C0010 | C0020 | C0030 |
| Basiskapitalgrundlag før fradrag af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer som omhandlet i artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35 | | | |
| Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) | R0010 | | |
| Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital | R0020 | | |
| Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | R0030 | | |
| Efterstillede gensidige medlemskonti | R0040 | | |
| Overskudskapital | R0050 | | |
| Præferenceaktier | R0060 | | |
| Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier | R0070 | | |
| Afstemningsreserve før fradrag af kapitalinteresser | R0080 | | |
| Efterstillet gæld | R0090 | | |
| Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto | R0100 | | |
| Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | R0110 | | |
| Ændring i basiskapitalgrundlagselementer i alt før justeringer | R0120 | | |
| Ændring i komponenter af afstemningsreserven — Elementer indberettet under "Kapitalgrundlag" | | | |
| Overskydende aktiver i forhold til passiver (ændringer i kapitalgrundlag forklaret ved skemaer vedrørende analyse af ændringer) | R0130 | | |
| Egne aktier | R0140 | | |
| Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer | R0150 | | |
| Andre basiskapitalgrundlagselementer | R0160 | | |
| Begrænsede kapitalgrundlagselementer — ring fencing og matchning | R0170 | | |

| | År N | År N-1 | Ændring |
|--|-------------|-------------|-------------|
| Ændring i alt vedrørende afstemningsreserven | | | |
| R0180 | | | |
| Oversigt over ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver | | | |
| Ændringer som følge af investeringer og finansielle forpligtelser | | | |
| R0190 | | | |
| Ændringer som følge af forsikringsmæssige hensættelser | | | |
| R0200 | | | |
| Ændringer i basiskapitalgrundlagselementer og andre godkendte poster | | | |
| R0210 | | | |
| Ændringer vedrørende udskudt skat | | | |
| R0220 | | | |
| Indkomstskat i indberetningsperioden | | | |
| R0230 | | | |
| Dividendeudlodning | | | |
| R0240 | | | |
| Andre ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver | | | |
| R0250 | | | |

S.29.02.01**Overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser****Analyse af udsving med indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver**

Heraf udsving i værdiansættelse med indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver

Udsving i værdiansættelse af investeringer

Udsving i værdiansættelse af egne aktier

Udsving i værdiansættelse af finansielle forpligtelser og efterstillet gæld

Heraf investeringsindtægter og -udgifter med indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver

Investeringsindtægter

Investeringsudgifter, herunder renteudgifter i forbindelse med efterstillet gæld og finansielle forpligtelser

Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser**Oplysninger om investeringsindtægter**

Udbytte

Renter

Leje

Andet

| | |
|--------------|--------------|
| | C0010 |
| R0010 | |
| R0020 | |
| R0030 | |
| | |
| R0040 | |
| R0050 | |
| R0060 | |
| | |
| R0070 | |
| R0080 | |
| R0090 | |
| R0100 | |

S.29.03.01

Overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes forsikringsmæssige hensættelser

Specifikation af ændring af bedste skøn — Eventuelt analyse pr. forsikringsår

| | | LIVSFORSIKRING | SKADESFORSIKRING |
|---|--------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | Uden fradrag af genforsikring | Uden fradrag af genforsikring |
| | | C0010 | C0020 |
| Bedste skøn primo | R0010 | | |
| Usædvanlige elementer, som udløser tilpasning af bedste skøn primo | R0020 | | |
| Afgrænsningsændringer | R0030 | | |
| Valutaændring | R0040 | | |
| Bedste skøn af risici accepteret i løbet af perioden | R0050 | | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes afvikling af diskonteringsats — risici accepteret forud for perioden | R0060 | | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes forventede ind- og udgående strømme i år N — risici accepteret forud for perioden | R0070 | | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes erfaring — risici accepteret forud for perioden | R0080 | | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer af ikkeøkonomiske antagelser — risici accepteret forud for perioden | R0090 | | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer i det økonomiske miljø — risici accepteret forud for perioden | R0100 | | |
| Andre ændringer, ikke forklaret andetsteds | R0110 | | |
| Bedste skøn ultimo | R0120 | | |

| | | LIVSFORSIKRING | SKADESFORSIKRING |
|--------------------|--------------|--|--|
| | | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler |
| | | C0030 | C0040 |
| Bedste skøn primo | R0130 | | |
| Bedste skøn ultimo | R0140 | | |

Specifikation af ændring af bedste skøn — Eventuelt analyse pr. ulykkesår

| | LIVSFORSIK- RING | SKADESFOR- SIKRING |
|---|----------------------------------|----------------------------------|
| | Uden fradrag af genforsikring | Uden fradrag af genforsikring |
| | C0050 | C0060 |
| Bedste skøn primo | R0150 | |
| Usædvanlige elementer, som udløser tilpasning af bedste skøn primo | R0160 | |
| Afgrænsningsændringer | R0170 | |
| Valutaændring | R0180 | |
| Ændring af bedste skøn for risici, der dækkes i løbet af perioden | R0190 | |
| Ændring af bedste skøn for risici, der dækkes i løbet af perioden | R0200 | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes afvikling af diskonteringsats — risici dækket forud for perioden | R0210 | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes forventede ind- og udgående strømme i år N — risici dækket forud for perioden | R0220 | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes erfaring og andre kilder — risici dækket forud for perioden | R0230 | |
| Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer af ikkeøkonomiske antagelser — risici dækket forud for perioden | R0240 | |
| Ændring af det bedste skøn, som skyldes ændringer i det økonomiske miljø — risici dækket forud for perioden | R0250 | |
| Andre ændringer, ikke forklaret andetsteds | R0260 | |
| Bedste skøn ultimo | R0270 | |

| | LIVSFORSIK- RING | SKADESFOR- SIKRING |
|--------------------|--|--|
| | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaf- taler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaf- taler |
| | C0070 | C0080 |
| Bedste skøn primo | R0280 | |
| Bedste skøn ultimo | R0290 | |

Justeringer af forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til værdiansættelsen af unit-linked aftaler, med en teoretisk set udlignende indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver

| | | LIVSFORSIK- RING |
|--|--------------|---------------------|
| | | C0090 |
| Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0300 | |

Forsikringsmæssige strømme med indvirkning på forsikringsmæssige hensættelser

| | | LIVSFORSIK- RING | SKADESFOR- SIKRING |
|---|--------------|---------------------|-----------------------|
| | | C0100 | C0110 |
| Præmier tegnet i perioden | R0310 | | |
| Krav og ydelser i perioden — med fradrag af restværdi og subrogation | R0320 | | |
| Udgifter (herunder ikke investeringsudgifter) | R0330 | | |
| Samlede forsikringsmæssige strømme med indvirkning på forsikringsmæssige bruttohensættelser | R0340 | | |
| Forsikringsmæssige strømme i tilknytning til genforsikring i perioden (modtagne tilbagekrævede beløb med fradrag af indbetalte præmier) | R0350 | | |

Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes forsikringsmæssige hensættelser

| | | LIVSFORSIK- RING | SKADESFOR- SIKRING |
|--|--------------|---------------------|-----------------------|
| | | C0120 | C0130 |
| Forsikringsmæssige bruttohensættelser | R0360 | | |
| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | R0370 | | |

S.29.04.01

Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser

Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsår

| |
|---------|
| Branche |
| Z0010 |

| | | Risici accepteret i løbet af perioden | Risici accepteret forud for perioden |
|--|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| | | C0010 | C0020 |
| Tegnede præmier tegnet i løbet af perioden | R0010 | | |
| Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | R0020 | | |
| Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | R0030 | | |
| Ændring af bedste skøn | R0040 | | |
| Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | R0050 | | |
| Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0060 | | |
| I alt | R0070 | | |

Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser — Ulykkesår

| | | Risici, der dækkes efter perioden | Risici, der dækkes i løbet af perioden | Risici, der accepteres forud for perioden |
|--|--------------|-----------------------------------|--|---|
| | | C0030 | C0040 | C0050 |
| Tegnede præmier | R0080 | | | X |
| Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | R0090 | | | |
| Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | R0100 | | | |
| Ændring af det bedste skøn | R0110 | | | |
| Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | R0120 | | | |
| Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | R0130 | | | |
| I alt | R0140 | | | |

S.30.01.01

Grundlæggende oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed

Fakultative dækninger for skadesforsikring (generelt set de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største)

| Kode for genforsikringsprogram | Risikoidentifikationskode | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Branche vedrørende skadesforsikring | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | Proportional | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | Risikobeskrivelse |
|--------------------------------|---------------------------|--|-------------------------------------|---|--|--------------|---|-------------------|
| C0020 | C0030 | C0040 | C0041 | C0042 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Gyldighedsperiode (startdato) | Gyldighedsperiode (slutdato) | Valuta | Forsikringssum | Type forsikringsmodel | Beløb i henhold til forsikringsmodel | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring med alle genforsikringselskaber | Fakultativ genforsikringspræmie cederet til alle genforsikringselskaber for 100 % af genforsikringsplaceringen |
|---|-------------------------------|------------------------------|--------|----------------|-----------------------|--------------------------------------|---|--|
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| | | | | | | | | |

Fakultative dækninger for livsforsikring (generelt set de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største)

| Kode for genforsikringsprogram | Risikoidentifikationskode | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Branche vedrørende livsforsikring | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | Proportional | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Gyldighedsperiode (startdato) |
|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------------------------|---|--|--------------|---|---|-------------------------------|
| C0190 | C0200 | C0210 | C0211 | C0212 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Gyldighedsperiode (slutdato) | Valuta | Forsikringssum | Risikosum | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring med alle genforsikringselskaber | Fakultativ genforsikringspræmie cederet til alle genforsikringselskaber for 100 % af genforsikringsplaceringen |
|------------------------------|--------|----------------|-----------|---|--|
| C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 |
| | | | | | |

S.30.02.01

Oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed

Fakultative dækninger for skadesforsikring (generelt set de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største)

| Kode for genforsikringsprogram | Risikoidentifikationskode | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Kode for genforsikrings-selskabet | Type genforsikringsselskab | Branche vedrørende skadesforsikring | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | Genforsikrings-selskabets andel (%) | Valuta | Genforsikringssum til det fakultative genforsikringsselskab | Fakultativ cederet genforsikringspræmie | Kommentarer |
|--------------------------------|---------------------------|--|-----------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|--------|---|---|-------------|
| C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0051 | C0061 | C0065 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | | | | | | | |

Fakultative dækninger for livsforsikring (generelt set de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største)

| Kode for genforsikringsprogram | Risikoidentifikationskode | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Genforsikrings-selskabets kode | Genforsikrings-selskabets kode-type | Branche vedrørende livsforsikring | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | Genforsikrings-selskabets andel (%) | Valuta | Genforsikringssum til det fakultative genforsikringsselskab | Fakultativ cederet genforsikringspræmie | Kommentarer |
|--------------------------------|---------------------------|--|--------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|--------|---|---|-------------|
| C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0181 | C0191 | C0195 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 |
| | | | | | | | | | | | |

Oplysninger specielt for genforsikringsselskaber

| Genforsikringsselskabets kode | Genforsikringsselskabets kode-type | Genforsikrings-selskabets registrerede navn | Genforsikrings-selskabets type | Hjemland | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitets-trin | Intern vurdering |
|-------------------------------|------------------------------------|---|--------------------------------|----------|--|--------------|----------------------|------------------|
| C0280 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | C0330 | C0340 | C0350 | C0360 |
| | | | | | | | | |

S.30.03.01

Grundlæggende oplysninger om cederede genforsikringprogrammer

| Kode for genforsikringsprogram | Identifikationskode for aftale | Løbenummer for afsnit i aftalen | Løbenummer for excedent ("surplus")/niveau ("layer") i program | Mængdeangivelse for excedent ("surplus")/niveau ("layer") i program | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | Branche | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Genforsikringsaftalens type | Medtagelse af genforsikringsdækning for katastrofer | Gyldighedsperiode (startdato) |
|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--|---|--|---------|---|-----------------------------|---|-------------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Gyldighedsperiode (slutdato) | Valuta | Type forsikringsmodel | Skønnede underliggende præmieindtægter (skadesexcedent — skønnede underliggende præmieindtægter) | Aftales skønnede bruttopræmieindtægter (proportionale og ikke-proportionale) | Aggregeret selvrisiko (beløb) | Aggregeret selvrisiko (%) | Tilbageholdelse eller prioritet (beløb) | Tilbageholdelse eller prioritet (%) | Begrænsning (beløb) | Begrænsning (%) |
|------------------------------|--------|-----------------------|--|--|-------------------------------|---------------------------|---|-------------------------------------|---------------------|-----------------|
| C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Største dækning pr. risiko eller begivenhed | Største dækning pr. aftale | Dækning af et lag, der er omfattet af genforsikring. | Antal genikrafttrædelser | Beskrivelse af genikrafttrædelser | Skadesexcedent sats 1 | Skadesexcedent sats 2 | Skadesexcedent fast præmie | Glidende provision | Minimumskvotefor krav, som den glidende provision er afhængig af | Maksimumskvotefor krav, som den glidende provision er afhængig af |
|---|----------------------------|--|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------|--|---|
| C0230 | C0240 | C0245 | C0250 | C0260 | C0360 | C0370 | C0380 | C0390 | C0400 | C0410 |
| | | | | | | | | | | |

| Mindste provision | Største provision | Forventet provision |
|-------------------|-------------------|---------------------|
| C0420 | C0430 | C0440 |
| | | |

S.30.04.01

Oplysninger om andele af cederede genforsikringprogrammer

| Kode for genforsikringsprogram | Identifikationskode for aftale | Løbenummer for afsnit i aftalen | Løbenummer for overskud i excedentkontrakter/lag i program | Genforsikringsselskabets kode | Kode for type genforsikringsselskab | Genforsikringsselskabets andel (%) | Eksponering cederet for genforsikringsselskabets andel (beløb) | Type sikkerhedsstillelse (hvis relevant) |
|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--|-------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|--|--|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0100 | C0110 | C0120 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| Beskrivelse af genforsikringsselskabets maksimale hæftelse med sikkerhedsstillelse | Kode for sikkerhedsstiller (hvis relevant) | Sikkerhedsstillers kodetype | Skønnet cederende genforsikringspræmie for genforsikringsselskabets andel | Kommentarer | Sikkerhedsstillers navn (hvis relevant) |
|--|--|-----------------------------|---|-------------|---|
| C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0320 |
| | | | | | |

Oplysninger om genforsikringsselskaber

| Genforsikringsselskabets kode | Genforsikringsselskabets kode-type | Genforsikringsselskabets registrerede navn | Genforsikringsselskabets type | Hjemland | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering |
|-------------------------------|------------------------------------|--|-------------------------------|----------|--|--------------|---------------------|------------------|
| C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| | | | | | | | | |

S.31.01.01

Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er)

| Genforsikrings-selskabs kode | Genforsikrings-selskabs kode-type | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Præmiehensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder NSLT-sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Erstatningshensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder NSLT-sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Forsikringsmæssige hensættelser vedrørende livsforsikring, herunder SLT-sygeforsikring | Justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Nettotilgodehavender | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikrings-selskabet | Finansielle garantier | Kontante indskud | Samlede modtagne garantier | Valuta |
|------------------------------|-----------------------------------|---|--|---|---|--|----------------------|---|-----------------------|------------------|----------------------------|--------|
| C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0155 |
| | | | | | | | | | | | | |

Oplysninger om genforsikrings-selskaber

| Genforsikrings-selskabs kode | Genforsikrings-selskabs kode-type | Genforsikrings-selskabs registrerede navn | Genforsikrings-selskabs type | Hjemland | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering |
|------------------------------|-----------------------------------|---|------------------------------|----------|--|--------------|---------------------|------------------|
| C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 |
| | | | | | | | | |

S.31.01.04

Genforsikringsandel, herunder finite reinsurance og SPV'er

| Registreret navn på genforsikret selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Genforsikringssselskabets kode | Genforsikringssselskabets kodetype | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Præmiehensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder NSLT-sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Erstatningshensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder NSLT-sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Forsikringsmæssige hensættelser vedrørende livsforsikring, herunder SLT-sygeforsikring | Justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse |
|--|---------------------------------|-------------------------|--------------------------------|------------------------------------|---|--|---|---|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Nettoutilgodehavender | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringssselskabet | Finansielle garantier | Kontante indskud | Samlede modtagne garantier | Valuta |
|--|-----------------------|---|-----------------------|------------------|----------------------------|--------|
| C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0155 |
| | | | | | | |

Oplysninger om genforsikringssselskaber

| Genforsikringssselskabets kode | Genforsikringssselskabets kodetype | Genforsikringssselskabets registrerede navn | Genforsikringssselskabets type | Hjemland | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering |
|--------------------------------|------------------------------------|---|--------------------------------|----------|--|--------------|---------------------|------------------|
| C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 |
| | | | | | | | | |

S.31.02.01

Special purpose vehicles (SPV'er)

| SPV's interne kode | ID-kode for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | ID-kodetype for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | Brancher med relation til SPV-securitisering | Udløsende faktor(er) i SPV'et | Aftalerelateret udløsende begivenhed | Samme udløsende begivenhed som i underliggende cedents portefølje? | Basisrisiko som følge af risikooverførsels opbygning | Basisrisiko som følge af aftalevilkår |
|--------------------|---|---|--|-------------------------------|--------------------------------------|--|--|---------------------------------------|
| C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| SPV-aktiver specifikt afgrænset (ring-fenced) til at indfri cedentspecifikke forpligtelser | Andre ikke-cedentspecifikke SPV-aktiver med eventuel mulighed for at gøre krav | Andre muligheder for at gøre krav som følge af securitisering | Størst mulige antal samlede forpligtelser fra SPV's side i henhold til genforsikringspolice | SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser i hele indberetningsperioden | Aktuelle beløb, som kan tilbagekræves fra SPV | Identifikation af væsentlige investeringer, som cedent besidder i SPV | Forvaltes securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent af anden tredjepart end cedent/organiserende institut? |
|--|--|---|---|--|---|---|--|
| C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| | | | | | | | |

Oplysninger om SPV

| SPV's interne kode | Kodetype for SPV | SPV's juridiske karakter | SPV's navn | SPV's registreringsnr. | Land, hvor SPV er godkendt | Betingelser for godkendelse af SPV | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering |
|--------------------|------------------|--------------------------|------------|------------------------|----------------------------|------------------------------------|--|--------------|---------------------|------------------|
| C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 |
| | | | | | | | | | | |

S.31.02.04

Special purpose vehicles (SPV'er)

| Registreret navn på genforsikret selskab | Identifikationskode for selskab | SPV's interne kode | ID-kode for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | ID-kodetype for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | Brancher med relation til SPV-securitisering | Udløsende faktor(er) i SPV'et | Aftalerelateret udløsende begivenhed | Samme udløsende begivenhed som i underliggende cedents portefølje? | Basisrisiko som følge af risikooverførsels opbygning |
|--|---------------------------------|--------------------|---|---|--|-------------------------------|--------------------------------------|--|--|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Basisrisiko som følge af aftalevilkår | SPV-aktiver specifikt afgrænset (ring-fenced) til at indfri cedentspecifikke forpligtelser | Andre ikkecedentspecifikke SPV-aktiver med eventuel mulighed for at gøre krav | Andre muligheder for at gøre krav som følge af securitisering | Størst mulige antal samlede forpligtelser fra SPV's side i henhold til genforsikringspolice | SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser i hele indberetningsperioden | Aktuelle beløb, som kan tilbagekræves fra SPV | Identifikation af væsentlige investeringer, som cedent besidder i SPV | Forvaltes securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent af anden tredjepart end cedent/organiserende institut? |
|---------------------------------------|--|---|---|---|--|---|---|--|
| C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 |
| | | | | | | | | |

Oplysninger om SPV

| SPV's interne kode | Kodetype for SPV | SPV's juridiske karakter | SPV's navn | SPV's registreringsnr. | Land, hvor SPV er godkendt | Betingelser for godkendelse af SPV | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | Udpeget ECAI | Kreditkvalitetstrin | Intern vurdering |
|--------------------|------------------|--------------------------|------------|------------------------|----------------------------|------------------------------------|--|--------------|---------------------|------------------|
| C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 |
| | | | | | | | | | | |

S.32.01.04

Selskaber, der indgår i koncernen

| Land | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Registreret navn på selskab | Type selskab | Selskabsform | Kategori (gensidigt/ikkegensidigt) | Tilsynsmyndighed | (forts.) |
|-------|---------------------------------|-------------------------|-----------------------------|--------------|--------------|------------------------------------|------------------|----------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | |
| | | | | | | | | |

Prioriteringskriterier (i koncernens indberetningsvaluta)

| Samlet balancesum (for (gen) forsikrings-selskaber) | Samlet balancesum (for andre regulerede selskaber) | Samlet balancesum (for ikkeregulerede selskaber) | Tegnede præmier med fradrag af genforsikring cederet i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP for (gen) forsikringsselskaber | Omsætning defineret som bruttoindtægter i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP for andre selskabstyper, for forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber. | Forsikringsresultater | Investeringsresultater | Samlede resultater | Regnskabsstandard | (forts.) |
|---|--|--|---|---|-----------------------|------------------------|--------------------|-------------------|----------|
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | |
| | | | | | | | | | |

| Indflydelseskriterier | | | | | | Omfattet af koncerntilsyn | | Beregning af koncernsolvens |
|-----------------------|---|---------------------|-----------------|-------------|--|---------------------------|---|--|
| Kapitalandel i % | procentsats anvendt ved opstillingen af de konsoliderede regnskaber | % stemmerettigheder | Andre kriterier | Indflydelse | Forholdsmæssig andel anvendt til beregning af koncernsolvensen | Ja/nej | Dato for afgørelsen, hvis artikel 214 finder anvendelse | Anvendt metode og for så vidt angår metode 1 behandling af selskabet |
| C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| Omfattet af den interne model for beregninger af solvenskapitalkrav på koncernniveau | Type volatilitetsjustering, der er anvendt i den interne model |
|--|--|
| C0270 | C0280 |
| | |

S.33.01.04

Individuelle krav for forsikrings- og genforsikringselskaber

| | | | | | EØS- og ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringselskaber (som anvender Solvens II-regler) | | | | | | |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|--|-------------|--|--------------------------------------|---|---|---|--|-------------------------------|
| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Enhedsniveau/Ringfenced fond eller matchtilpasningsportefølje/Resterende del | Fondsnummer | Solvenskaptalkrav for markedsrisici | Solvenskaptalkrav for modpartsrisici | Solvenskaptalkrav for livsforsikringsrisici | Solvenskaptalkrav for sygeforsikringsrisici | Solvenskaptalkrav for skadesforsikringsrisici | Solvenskaptalkrav for Operationelle risici | Individuelt solvenskaptalkrav |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 |
| | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| EØS- og ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringselskaber (som anvender Solvens II-regler) | | | | | | | | | | |
|--|--|--|----------------------|------------------------------------|---|---|--|--------------------------------------|---------------|-------------------------------|
| Individuelt minimumskapitalkrav | Anerkendt individuelt kapitalgrundlag til dækning af teoretisk kapitalkrav | Standardformel anvendt | | | Anvendt koncernintern model eller individuel intern model | | | Kapitaltillæg på individuelt niveau | | |
| | | Anvendelse af selskabsspecifikke parametre | Brug af forenklinger | Anvendelse af partiel intern model | Koncernintern model eller individuel intern model | Dato for oprindelig godkendelse af intern model | Dato for godkendelse af seneste større ændring af intern model | Dato for beslutning om kapitaltillæg | Kapitaltillæg | Begrundelse for kapitaltillæg |
| C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringselskaber (som anvender eller ikke anvender Solvens II-regler), uanset anvendt metode | | | EØS- og ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringselskaber |
|---|----------------------------|---|--|
| Lokalt solvenskapitalkrav | Lokalt minimumskapitalkrav | Anerkendt kapitalgrundlag i henhold til lokale regler | Bidrag fra det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav |
| C0240 | C0250 | C0260 | C0270 |
| | | | |

S.34.01.04

Individuelle krav vedrørende andre regulerede finansielle selskaber og andre ikkeregulerede finansielle selskaber, herunder forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Aggregeret eller ikke | Type kapitalkrav | Teoretisk solvenskapitalkrav og sektorrelateret kapitalkrav | Teoretisk minimumskapitalkrav og sektorrelateret minimumskapitalkrav | Teoretisk eller sektorrelateret anerkendt kapitalgrundlag | Bidrag fra det enkelte selskabs (teoretiske) solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|-----------------------|------------------|---|--|---|---|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0085 |
| | | | | | | | | |

S.35.01.04

Bidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser

| Registreret navn på selskab | Identifikationskode for selskab | ID-kodetype for selskab | Anvendt beregningsmetode for koncernsolvens | Forsikringsmæssige hensættelser i alt | | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | | | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | | |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------|---|--|--|--|--|--|--|--|--|
| | | | | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 |
| | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | | | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) | | | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked forsikring | | | Overgangsforanstaltning vedrørende forsikrings- mæssige hensættelser | |
|---|---|--|---|---|---|--|---|---|--|---|
| Forsikrings- mæssige hensættelser uden fradrag af koncer- interne trans- aktioner | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) | Nettobidrag til koncer- nens forsikringsmæs- sige hensættelser (%) | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncer- interne transaktioner | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) | Forsikrings- mæssige hensættelser uden fradrag af koncer- interne transaktio- ner | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) | Forsikrings- mæssige hensættelser uden fradrag af koncer- interne transaktio- ner | Nettobidrag til koncer- nens forsik- ringsmæssige hensættelser (%) |
| C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 |
| | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltninger vedrørende den risikofrie rente | Langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af volatilitetsjustering | Langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af matchtilpasning |
|--|--|--|
| Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncernterne trans- aktioner | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncernterne trans- aktioner | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncernterne trans- aktioner |
| C0240 | C0250 | C0260 |
| | | |

S.36.01.01

Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel

| Koncernintern transaktions-ID | Investors/långivers navn | Identifikationskode for investor/långiver | Kodetype for investor/långiver | Sektoren for investor/långiver | Udsteders/låntagers navn | Identifikationskode for udsteder/låntager | Kodetype for udsteder/låntager | Sektor for udsteder/låntager | Indirekte transaktioner |
|-------------------------------|--------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------|---|--------------------------------|------------------------------|-------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0031 | NC0040 | C0050 | C0060 | C0061 | NC0070 | NC0080 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| En enkelt økonomisk transaktion | ID-kode for instrument | ID-kode for type instrument | Instrumenttype | Instrument | Udstedelsesdato | Udløbsdato | Transaktionsvaluta | Beløb på transaktionsdatoen | Beløb på indberetningsdatoen |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------------|----------------|------------|-----------------|------------|--------------------|-----------------------------|------------------------------|
| NC0090 | NC0100 | NC0101 | NC0110 | NC0120 | NC0130 | NC0140 | NC0150 | NC0160 | NC0170 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Værdi af sikkerhedsstillelse | Udbytte/renter/kuponer og andre betalinger i indberetningsperioden | Kupon-/rentesats | Bemærkninger |
|------------------------------|--|------------------|--------------|
| NC0180 | NC0190 | C0200 | C0210 |
| | | | |

S.36.02.01

Koncerninterne transaktioner — Derivater

| Koncernintern transaktions-ID | Investor/køber | Identifikationskode for investor/køber | Kodetype for investor/køber | Sektoren for investor/køber | Udsteders/sælgers navn | Identifikationskode for investor/sælger | Kodetype for udsteder/sælger | Finanssektor for investor/sælger | Indirekte transaktioner | En enkelt økonomisk transaktion | ID-kode for instrument | ID-kode for type instrument |
|-------------------------------|----------------|--|-----------------------------|-----------------------------|------------------------|---|------------------------------|----------------------------------|-------------------------|---------------------------------|------------------------|-----------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0031 | NC0040 | C0050 | C0060 | C0061 | NC0070 | NC0080 | NC0090 | NC0100 | NC0101 |
| | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Beskrivelse af dokumentet | | | Transaktionens udløb | | Transaktionsbeløb | | | | Underliggende aktiver | | | |
|---------------------------|----------------|---------------------------|----------------------|------------|--------------------|----------------|-----------------------|------------------------------|--|---|--|--|
| Instrument-type | Type afdækning | Formålet med instrumentet | Startdato | Udløbsdato | Transaktionsvaluta | Notionel værdi | Regnskabsmæssig værdi | Værdi af sikkerhedsstillelse | Identifikationskode for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet | Kodetype for det aktiv eller den forpligtelse, der ligger til grund for derivatet | Swaps — Betalt rente ved en swap (for køber) | Swaps — Modtaget rente ved en swap (for køber) |
| NC0110 | NC0120 | NC0130 | NC0140 | NC0150 | NC0160 | NC0170 | NC0180 | NC0190 | NC0200 | NC0201 | NC0220 | NC0230 |
| | | | | | | | | | | | | |

(forts.)

| Underliggende aktiver | | Tilknyttede overskud og tab | Bemærkninger |
|--|---|-----------------------------|--------------|
| Swaps — Afleveret valuta ved en swap (for køber) | Swaps — Modtaget valuta ved en swap (for køber) | Indtægter fra derivater | |
| NC0240 | C0250 | C0260 | C0270 |
| | | | |

S.36.03.01

Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser

| Identifikation af transaktionen | | | | | | | |
|---------------------------------|--------------------------|--|-----------------------------|------------------------------------|------------------|--|-------------------------------|
| Koncernintern transaktions-ID | Navnet på garantistiller | Identifikationskode for garantistiller | Kodetype for garantistiller | Garantistillers finansielle sektor | Modtagerens navn | Identifikationskode for den begunstigede | Kodetype for den begunstigede |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0031 | C0040 | C0050 | C0060 | C0061 |
| | | | | | | | |

(forts.)

| Identifikation af transaktionen | | | | Transaktionens udløb | | Transaktionens værdi | |
|--------------------------------------|-------------------------|---------------------------------|------------------|------------------------------|---|----------------------|----------------------|
| Den begunstigedes finansielle sektor | Indirekte transaktioner | En enkelt økonomisk transaktion | Transaktionstype | Transaktions udstedelsesdato | Udløbsdato for den aftale, der ligger til grund for transaktionen | Transaktionsvaluta | Udløsende begivenhed |
| C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 |
| | | | | | | | |

(forts.)

| Transaktionens værdi | | | | Tilknyttede overskud og tab | Bemærkninger |
|--------------------------------|--|---|------------------------------|---------------------------------------|--------------|
| Transaktionsværdi på startdato | Transaktionsværdi på indberetningsdato | Højeste mulige værdi af eventualforpligtelser | Værdi af garanterede aktiver | Indtægter fra ikkebalanceførte poster | |
| C0150 | C0160 | C0170 | C0180 | C0190 | C0200 |
| | | | | | |

S.36.04.01

Koncerninterne transaktioner —Forsikring og genforsikring

| Identifikation af transaktionen | | | | | | | | | |
|---------------------------------|-----------------------------------|---|----------------------------------|------------------------------------|---|---|---|--|-------------------------|
| Koncernintern transaktions-ID | Navnet på forsikringstager/cedent | Identifikationskode for forsikringstager/cedent | Kode for forsikringstager/cedent | Sektor for forsikringstager/cedent | Navn på forsikrings-/genforsikringselskabet | Identifikationskode for forsikrings-/genforsikringselskab | Kodetype for forsikringselskab/genforsikringselskab | Sektor for forsikrings-/genforsikringselskabet | Indirekte transaktioner |
| C0010 | C0020 | C0030 | C0031 | C0040 | C0050 | C0060 | C0061 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Identifikation af transaktionen | Beskrivelse af dokumentet | | Transaktionens gyldighedsperiode | | Transaktionsbeløb | | | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler |
|---------------------------------|---------------------------------|------------------|----------------------------------|-----------|-------------------|--------------------|---|---|
| | En enkelt økonomisk transaktion | Transaktionstype | Transaktion | Startdato | Udløbsdato | Transaktionsvaluta | Dent maksimale dækningsbeløb for en transaktion | |
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 | C0160 | C0170 |
| | | | | | | | | |

(forts.)

| Tilknyttede overskud og tab | | | | Bemærkninger |
|--|--------------------------|-------------------------------|---------|--------------|
| Teknisk genforsikringsresultat (for genforsikring) | Præmier (for forsikring) | Erstatninger (for forsikring) | Branche | |
| C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 |
| | | | | |

S.36.05.01

Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab)

| Koncernintern transaktions-ID | Navnet på indtægtssiden | Identifikationskode for indtægtsside | Kodetype for indtægtsside | Sektoren for indtægtssiden | Navnet på udgiftssiden | Identifikationskode for indtægtsside | Kodetype for udgiftsside | Sektoren for udgiftssiden | Indirekte transaktioner |
|-------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|------------------------|--------------------------------------|--------------------------|---------------------------|-------------------------|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0031 | C0040 | C0050 | C0060 | C0061 | C0070 | C0080 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| En enkelt økonomisk transaktion | Beskrivelse af dokumentet | | Nærmere angivelser vedrørende transaktionen | | | Bemærkninger |
|---------------------------------|---------------------------|-------------|---|------------------|-------|--------------|
| | Transaktionstype | Transaktion | Transaktionsvaluta | Transaktionsdato | Beløb | |
| C0090 | C0100 | C0110 | C0120 | C0130 | C0140 | C0150 |
| | | | | | | |

S.37.01.04

Risikokoncentration — Eksponering over for modparter

| Navn på ekstern modpart | Identifikationskode for koncernens eksterne modpart | Type identifikationskode for koncernens eksterne modpart | Navnet på koncernen (i tilfælde af en gruppe modparter) | Vurdering | Udpeget ECAI | Sektor | Land | Koncernenhed | Identifikationskode for koncernens enhed |
|-------------------------|---|--|---|-----------|--------------|--------|-------|--------------|--|
| C0010 | C0020 | C0030 | C0045 | C0080 | C0090 | C0100 | C0040 | C0011 | C00120 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| ID-kode for type koncernenhed | Aktier | Obligationer | Aktiver, hvis risici hovedsageligt er båret af forsikrings-tagere | Derivater | Øvrige investeringer | Lån, herunder realkreditlån | Garantier og tilsagn | Forsikringspolicer | Ekstern genforsikring |
|-------------------------------|--------|--------------|---|-----------|----------------------|-----------------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|
| C0125 | C0180 | C0190 | C0200 | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 |
| | | | | | | | | | |

(forts.)

| Andre direkte eksponeringer | Beskrivelse af "Andet" | Indirekte eksponeringer | Transaktioner med eksponering mod underliggende aktiver | Valuta | Eksponering i alt | Risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer | Fritagelser | Eksponeringer efter risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer og fritagelser |
|-----------------------------|------------------------|-------------------------|---|--------|-------------------|---|-------------|--|
| C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0160 | C0150 | C0310 | C0320 | C0330 |
| | | | | | | | | |

S.37.02.04**Risikokoncentration — Eksponering efter valuta, sektor, land****Eksponering efter valuta**

| Valutaområde | Nettoeksponering | % |
|--------------|------------------|-------|
| C0010 | C0030 | C0040 |
| | | |

Eksponering efter sektor

| Sektor | Nettoeksponering | % |
|--------|------------------|-------|
| C0050 | C0030 | C0040 |
| | | |

Eksponering efter land

| Land | Nettoeksponering | % |
|-------|------------------|-------|
| C0060 | C0030 | C0040 |
| | | |

I alt

| | | I alt — Nettoeksponering |
|--------------------------|--------------|--------------------------|
| | | C0070 |
| Eksponering efter valuta | R0010 | |
| Eksponering efter sektor | R0020 | |
| Eksponering efter land | R0030 | |

S.37.03.04**Risikokoncentration — Eksponering efter aktivklasse og vurdering**

| | |
|-----------------|-------|
| Obligationstype | Z0010 |
|-----------------|-------|

Aktier

| | | Nettoeksponering |
|-------|-------|------------------|
| | | C0010 |
| I alt | R0010 | |

Obligationer

| | | Nettoeksponering | % |
|-----------------------------|-------|------------------|-------|
| | | C0010 | C0020 |
| AAA | R0020 | | |
| AA | R0030 | | |
| A | R0040 | | |
| BBB | R0050 | | |
| Uden for investeringsklasse | R0060 | | |
| I alt | R0070 | | |

BILAG II

Vejledning til indberetningskemaer for individuelle selskaber

Dette bilag indeholder yderligere vejledning vedrørende skemaerne i bilag I til denne forordning. I første kolonne i tabellerne er angivet de poster, som skal indberettes, idet kolonnerne og rækkerne er anført, som de optræder i skemaet i bilag I.

Skemaer, som skal udfyldes i overensstemmelse med vejledningerne i de forskellige afsnit i dette bilag, benævnes »dette skema« i hele bilagets tekst.

Alle henvisninger til artikler bør henvise til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II), medmindre andet er anført.

S.01.01 — Indberetningens indhold*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Når der er behov for en særlig begrundelse, skal forklaringen ikke afgives i indberetningskemaet, men indgå i dialogen mellem selskaberne og nationale kompetente myndigheder.

Når et skema indgives kun med »nuller« og uden tal, angives der i S.01.01 én af de »ikke indberettede« valgmuligheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0010 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0020 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0010 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| C0010/R0010 | S.01.02 — Grundlæggende oplysninger — Generelt | Dette skema skal altid indgives. Den eneste mulighed er: 1 — Indberettet |
| C0010/R0020 | S.01.03 — Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0030 | S.02.01 — Balance | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 6 — Undtaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0040 | S.02.02 — Passiver efter valuta | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0060 | S.03.01 — Ikkebalanceførte poster — Generelt | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen ikkebalanceførte poster 3 — Ikke indberettet som følge af en værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser under tærsklen, og der er ikke givet eller modtaget nogen ubegrænset garanti, jf. vejledningerne til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0100 | S.04.02 — Oplysninger om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til Solvens II-direktivet, undtagen fragtførerens ansvar | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen virksomhed uden for hjemlandet vedrørende den pågældende forsikringsklasse 18 — Ikke indberettet, ingen direkte forsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0104 | S.04.03 — Grundlæggende oplysninger — liste over forsikringsudbydende enheder | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen virksomhed uden for hjemlandet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0105 | S.04.04 — Aktivitet efter land — det sted, hvor forsikringen tegnes | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen virksomhed uden for hjemlandet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0106 | S.04.05 — Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen virksomhed uden for hjemlandet 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0110 | S.05.01 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0140 | S.06.02 — Liste over aktiver | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse)</p> |
| C0010/R0150 | S.06.03 — Kollektive investeringsinstitutter — se-igennem-metode | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen kollektive investeringsinstitutter (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse)</p> |
| C0010/R0151 | S.06.04 — Risici som følge af klimaændringer i relation til investeringer | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse)</p> |
| C0010/R0160 | S.07.01 — Strukturerede produkter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen strukturerede produkter (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0170 | S.08.01 — Åbne derivater | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen derivattransaktioner (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0190 | S.09.01 — Indtægter/gevinster og tab i perioden | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0200 | S.10.01 — Værdipapirudlån og -genkøb | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen værdipapirudlån og -genkøb (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0210 | S.11.01 — Aktiver, der besiddes som sikkerhed | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen aktiver, der besiddes som sikkerhed, (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0220 | S.12.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen livs- og SLT-sygeforsikringsvirksomhed, (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0230 | S.12.02 — Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring — efter land | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen livs- og SLT-sygeforsikringsvirksomhed</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0240 | S.13.01 — Fremskrivning af fremtidige cash flow, opgjort brutto | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen livs- og SLT-sygeforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0250 | S.14.01 — Analyse af livsforsikringsforpligtelser | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen livs- og SLT-sygeforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0251 | S.14.02 — Skadesforsikring — oplysninger om policer og kunder | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0252 | S.14.03 — Forsikring mod cyberrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen dækning af cyberrisici</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0280 | S.16.01 — Oplysninger om annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsvirksomhed | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0290 | S.17.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed (kun for selskaber, der ikke er fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8)</p> <p>6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0300 | S.17.02 — Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring — efter land | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0310 | SR.18.01 — Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Skadesforsikring) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0320 | S.19.01 — Skadesforsikrings- erstatninger | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0330 | S.20.01 — Udvikling i fordelingen af erstatnings- udgifter | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 18 — Ikke indberettet, ingen direkte forsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0340 | S.21.01 — Risikoprofil for fordeling af tab | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 18 — Ikke indberettet, ingen direkte forsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0350 | S.21.02 — Skadesforsikrings- risici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 18 — Ikke indberettet, ingen direkte forsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0360 | S.21.03 — Fordeling af skadesforsikringsrisici — efter forsikringssum | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen skadesforsikringsvirksomhed 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 18 — Ikke indberettet, ingen direkte forsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0370 | S.22.01 — Virkning af lang- sigtede garantier og over- gangsforanstaltninger | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, der anvendes ingen langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0380 | S.22.04 — Overgangsforanstaltninger for beregning af rentesatser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, der anvendes ingen sådanne overgangsforanstaltninger 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0390 | S.22.05 — Overordnet beregning af overgangsforanstaltningerne for forsikringsmæssige hensættelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, der anvendes ingen sådanne overgangsforanstaltninger 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0400 | S.22.06 — Bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering efter land og valuta | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, der anvendes ingen volatilitetsjustering 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0410 | 23.01 — Kapitalgrundlag | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 6 — Fritaget i henhold til artikel 35, stk. 6-8 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0420 | S.23.02 — Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag opdelt efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital (tidligere benævnt tiers) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0430 | S.23.03 — Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0440 | S.23.04 — Liste over kapitalgrundlagselementer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |
| C0010/R0450 | S.24.01 — Kapitalinteresser, der besiddes | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, der besiddes ingen kapitalinteresser 0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0460 | S.25.01 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender standardformlen | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0470 | S.25.05 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0500 | S.26.01 — Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0510 | S.26.02 — Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, da indberetning er sket under niveauet for ring-fenced fonde/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0520 | S.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0530 | S.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0540 | S.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0550 | S.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0560 | S.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da ingen forenkede beregninger anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0561 | S.26.08 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0562 | S.26.09 — Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0563 | S.26.10 — Intern model — Risiko ved kreditbegivenhed — Porteføljeoversigt | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0564 | S.26.11 — Intern model — Nærmere oplysninger om kreditrisici for finansielle instrumenter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0565 | S.26.12 — Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0566 | S.26.13 — Intern model — Skades- og sygeforsikring (Ikke-SLT) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0567 | S.26.14 — Intern model — Livs- og sygeforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0568 | S.26.15 — Intern model — Operationel risiko | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes 5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes 10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0569 | S.26.16 — Intern model — Ændringer af modellen | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes 5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes 10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0570 | S.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikrings- katastroferisici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen risici 8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes 9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes 11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0580 | S.28.01 — Minimumskapital- krav — udelukkende livsforsikrings- eller livsgenforsikringsvirksomhed eller udeluk- kende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksom- hed | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, både livsforsikrings- eller skadesforsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0590 | S.28.02 — Minimumskapital- krav — både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksom- hed | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, udelukkende livsforsikrings- eller livsgenforsikringsvirksomhed eller udelukkende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksomhed 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0600 | S.29.01 — Overskydende aktiver i forhold til passiver | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0610 | S.29.02 — Overskydende aktiver i forhold til passiver — det skyldes investeringer og finansielle forpligtelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0620 | S.29.03 — Overskydende aktiver i forhold til passiver — det skyldes forsikringsmæssige hensættelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0630 | S.29.04 — Detaljeret analyse efter periode — forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0640 | S.30.01 — Grundlæggende oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen fakultative dækninger 3 — Ikke indberettet, da modtagne beløb er under tærskelværdien, jf. vejledningerne til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0650 | S.30.02 — Oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen fakultative dækninger 3 — Ikke indberettet, da modtagne beløb er under tærskelværdien, jf. vejledningerne til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0660 | S.30.03 — Grundlæggende data om cederede genforsikringsprogrammer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen genforsikring 3 — Ikke indberettet, da modtagne beløb er under tærskelværdien, jf. vejledningerne til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0670 | S.30.04 — Data om andele for cederede genforsikringsprogrammer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen genforsikring 3 — Ikke indberettet, da modtagne beløb er under tærskelværdien, jf. vejledningerne til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0680 | S.31.01 — Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen genforsikring 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0690 | S.31.02 — Special Purpose Vehicles | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen SPV'er 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0740 | S.36.01 — Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel 12 — Ikke indberettet, da intet moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, og selskabet ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i Solvens II-direktivet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0750 | S.36.02 — Koncerninterne transaktioner — Derivater | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i derivater 12 — Ikke indberettet, da intet moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, og selskabet ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i Solvens II-direktivet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0760 | S.36.03 — Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i ikkebalanceførte poster og eventualforpligtelser 12 — Ikke indberettet, da intet moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, og selskabet ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i Solvens II-direktivet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0770 | S.36.04 — Koncerninterne transaktioner — Forsikring og genforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i forsikring og genforsikring</p> <p>12 — Ikke indberettet, da intet moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, og selskabet ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i Solvens II-direktivet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0775 | S.36.05 — Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner</p> <p>12 — Ikke indberettet, da intet moderselskab er et blandet forsikringsholdingselskab, og selskabet ikke er del af en koncern som omhandlet i artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i direktiv 2009/138/EF</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0790 | SR.02.01 — Balance | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>14 — Ikke indberettet, da det drejer sig om en matchtilpasningsportefølje</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0800 | SR.12.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje eller ingen livs- og SLT-sygeforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0810 | SR.17.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje eller ingen skadesforsikringsvirksomhed</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0820 | SR.22.02 — Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Matchtilpasningsporteføljer) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da der ikke anvendes matchtilpasning</p> <p>15 — Ikke indberettet, da det drejer sig om en ring-fenced fond eller resterende del</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0830 | SR.22.03 — Oplysninger om beregning af matchtilpasning | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da der ikke anvendes matchtilpasning</p> <p>15 — Ikke indberettet, da det drejer sig om en ring-fenced fond eller resterende del</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0840 | SR.25.01 — Solvenskapitalkrav — Kun standardformel | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0855 | SR.25.05 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0870 | SR.26.01 — Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0880 | SR.26.02 — Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | | <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0890 | SR.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0900 | SR.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0910 | SR.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0920 | SR.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0930 | SR.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da ingen forenklede beregninger anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0935 | SR.26.08 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0940 | SR.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringskatastroferisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

S.01.02 — Grundlæggende oplysninger*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0010 | Selskabets navn | Registreret navn på selskab Det skal være konsistent i alle indberetninger. |
| C0010/R0020 | Selskabets identifikationskode | Identifikationskoden for selskabet ved hjælp af LEI-koden (Legal Entity Identifier). |
| C0010/R0040 | Type selskab | Angiv typen af indberettende selskab. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes til at angive selskabets aktivitetsområde: 2 — Livsforsikringselskaber 3 — Skadesforsikringselskaber 4 — Forsikringselskaber, der udøver livsforsikrings- og skadesforsikringsaktiviteter vedrørende de risici, der er opført i klasse 1 og 2, i del A, i bilag I — Artikel 73, stk. 2 5 — Forsikringselskaber, der udøver både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed — Artikel 73, stk. 5 6 — Genforsikringselskaber |
| C0010/R0050 | Land, hvor tilladelse er meddelt | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor selskabet er meddelt tilladelse (hjemland). |
| C0010/R0070 | Indberetningssprog | Angiv ISO 639-1-koden (2 bogstaver) for det sprog, der anvendes til indberetning af oplysninger. |
| C0010/R0080 | Indberetningsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor indberetningen indgives til tilsynsmyndigheden. |
| C0010/R0081 | Regnskabsårets udgang | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor selskabets regnskabsår slutter, f.eks. 01-12-2017. |
| C0010/R0090 | Referencedato for indberetning | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, som er den sidste dag i indberetningsperioden. |
| C0010/R0100 | Regelmæssig indberetning/ad hoc-indberetning | Angiv, om indberetningen vedrører regelmæssig indberetning eller ad hoc-indberetning. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Regelmæssig indberetning 2 — Ad hoc-indberetning 3 — Genindberetning af S.30-skemaer ifølge vejledningen til skemaet 4 — Tom indberetning |
| C0010/R0110 | Indberetningsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, som beløbene i de enkelte indberetninger oplyses i. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0120 | Regnskabsstandarder | <p>Angiv, hvilke regnskabsstandarder der anvendes til indberetningen af poster i S.02.01, værdiansættelse af regnskabet. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Selskabet anvender IFRS</p> <p>2 — Selskabet anvender lokale generelt accepterede regnskabsprincipper («GAAP») (ikke IFRS)</p> |
| C0010/R0130 | Beregningsmetode for solvenskapitalkravet | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at beregne solvenskapitalkravet. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Standardformel</p> <p>2 — Partiel intern model</p> <p>3 — Komplet intern model</p> |
| C0010/R0140 | Anvendelse af selskabsspecifikke parametre | <p>Angiv, om selskabet indberetter tal under anvendelse af selskabsspecifikke parametre. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes selskabsspecifikke parametre</p> <p>2 — Der anvendes ikke selskabsspecifikke parametre</p> |
| C0010/R0150 | Ring-fenced fonde | <p>Angiv, om selskabet indberetter virksomhed efter ring-fenced fonde. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der indberettes virksomhed efter ring-fenced fonde</p> <p>2 — Der indberettes ikke virksomhed efter ring-fenced fonde</p> |
| C0010/R0170 | Matchtilpasning | <p>Angiv, om selskabet indberetter tal under anvendelse af matchtilpasning. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes matchtilpasning</p> <p>2 — Der anvendes ikke matchtilpasning</p> |
| C0010/R0180 | Volatilitetsjustering | <p>Angiv, om selskabet indberetter tal under anvendelse af volatilitetsjustering. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes volatilitetsjustering</p> <p>2 — Der anvendes ikke volatilitetsjustering</p> |
| C0010/R0190 | Overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter | <p>Angiv, om selskabet indberetter tal under anvendelse af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter</p> <p>2 — Der anvendes ikke overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter</p> |
| C0010/R0200 | Overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | <p>Angiv, om selskabet indberetter tal under anvendelse af overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser</p> <p>2 — Der anvendes ikke overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0210 | Første indberetning eller genindberetning | <p>Angiv, om det drejer sig om en første indberetning af oplysninger eller en genindberetning af oplysninger vedrørende en tidligere indberetningsreferencedato. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Første indberetning 2 — Genindberetning</p> |
| R0250 | Fritagelse fra indberetning af ECAI-oplysninger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fritaget for aktiver (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7) 2 — Fritaget for aktiver (på grundlag af outsourcing) 3 — Fritaget for derivater (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7) 4 — Fritaget for derivater (på grundlag af outsourcing) 5 — Fritaget for aktiver og derivater (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7) 6 — Fritaget for aktiver og derivater (på grundlag af outsourcing) 0 — Ikke fritaget.</p> |
| C0010/R0255 | Direkte URL-link til det websted, hvor rapporten om solvens og finansiell situation er offentliggjort | <p>Inkluder den direkte webadresse til det websted, hvor rapporten om solvens og finansiell situation (SFCR) svarende til den referencedato for indberetning, jf. C0010/R0081 »Regnskabsårets udgang« vil blive offentliggjort. Hvis selskabet ikke har noget websted, indberettes det som »SELSKAB UDEN WEBSTED«.</p> |
| C0010/R0260 | Direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation | <p>Inkluder den direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation (SFCR) svarende til den referencedato for indberetning som anført i C0010/R0081 »Regnskabsårets udgang«.</p> <p>Webadressen skal føre direkte til en fil, der indeholder SFCR, og ikke til et websted.</p> <p>Alternativt, hvis SFCR allerede foreligger på datoen for indberetning, eller hvis rapporten ikke er offentliggjort på et websted, skal filen indgå i den årlige indberetning, og i denne celle skal én af følgende valgmuligheder udvælges:</p> <p>»SFCR-fil leveret« »SFCR-fil ikke leveret«</p> <p>Hvis »fil ikke leveret« er valgt, skal der vedlægges en forklaring til den nationale kompetente myndighed.</p> |
| C0010/R0270 | Captive-virksomhed | <p>Angiv om et selskab udfører captive-virksomhed i overensstemmelse med artikel 13 i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>1 — Captive-virksomhed 2 — Ingen captive-virksomhed</p> |

| | | |
|-------------|---|--|
| C0010/R0280 | Afviklingsvirksomhed (Run-Off Business) | <p>Denne post finder ikke anvendelse på selskaber, hvis tilladelse er trukket tilbage.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Selskaber, der afvikler en portefølje af forsikringsaftaler, men ikke hele deres forretningsvirksomhed (delvis afviklende selskab eller selskab med portefølje under afvikling)</p> <p>2 — Selskaber, der afvikler hele deres (hidtidige) forretningsvirksomhed (komplet afviklende selskab)</p> <p>3 — Selskaber med en særlig model for afviklingsvirksomhed (specialiseret afviklingsvirksomhed) — forsikringselskaber eller -koncerner, hvis forretningsmodel består i aktiv erhvervelse af såkaldte legacy-porteføljer eller hele forsikringstager under afvikling.</p> <p>4 — Ingen afviklingsvirksomhed</p> |
| C0010/R0290 | Fusioner og overtagelser i perioden | <p>Angiv, om fusioner og overtagelser eller afhændelse af aktiviteter, der påvirker indberettede oplysninger, fandt sted under indberetningsperioden.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — Nej</p> |

S.01.03 — Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Alle ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer bør angives, uanset om de er væsentlige for indberetningen af oplysninger eller ej.

I den første tabel indberettes alle ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer. Hvis en ring-fenced fond har en matchtilpasningsportefølje, der ikke dækker hele den ring-fenced fond, angives tre fonde, en for den ring-fenced fond, en for matchtilpasningsporteføljen i den ring-fenced fond og en for fondens resterende del (omvendt i de tilfælde, hvor en matchtilpasningsportefølje har en ring-fenced fond).

I den anden tabel forklares forbindelserne mellem fondene som forklaret i det foregående afsnit. Kun fonde med sådanne forbindelser indberettes i den anden tabel.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Liste over alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer (overlapping tilladt)

| | | |
|-------|---|---|
| C0040 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Nummer, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer, der tildeles hver ring-fenced fond og matchtilpasningsportefølje. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljen i andre skemaer.</p> |
| C0050 | Navn på ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje | <p>Angiv navnet på den ring-fenced fond og matchtilpasningsporteføljen.</p> <p>Når det er muligt (hvis fonden er knyttet til et kommercielt produkt), anvendes det kommercielle navn. Hvis det ikke er muligt, f.eks. hvis fonden er knyttet til flere kommercielle produkter, skal der anvendes et andet navn.</p> <p>Navnet skal være unikt og konsistent over tid.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0060 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del af en fond | <p>Angiv, om det drejer sig om en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. I de tilfælde, hvor der indgår andre fonde i én fond, skal i denne celle angives typen af hver fond eller afdeling. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond</p> <p>2 — Matchtilpasningsportefølje</p> <p>3 — Resterende del af en fond</p> |
| C0070 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | <p>Angiv, om den udpegede fond indeholder andre fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fond, hvori der indgår andre fonde</p> <p>2 — Ikke en fond, hvori der indgår andre fonde</p> <p>Kun »moderfonden« angives under valgmulighed 1.</p> |
| C0080 | Materiale | <p>Angiv, om den ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje er væsentlig med henblik på detaljeret indberetning af oplysninger. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Væsentlig</p> <p>2 — Ikke væsentlig</p> <p>I tilfælde af fonde, hvori der indgår andre fonde, skal denne post kun indberettes for »moderfonden«.</p> |
| C0090 | Artikel 304 | <p>Angiv, om den ring-fenced fond falder ind under Solvens II-direktivets artikel 304. En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond omfattet af artikel 304 — med mulighed for delmodulet for aktierisici</p> <p>2 — Ring-fenced fond omfattet af artikel 304 — uden mulighed for delmodulet for aktierisici</p> <p>3 — Ring-fenced fond ikke omfattet af artikel 304</p> |

Liste over ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer

| | | |
|-------|---|--|
| C0100 | Antal ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | <p>I forbindelse med de fonde, hvori der indgår andre fonde (mulighed 1 indberettet under post C0070), angives det under post C0040 anførte nummer.</p> <p>Fonden gentages i så mange rækker, som der kræves for at indberette de omfattede fonde.</p> |
| C0110 | Antal afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Angiv antallet af fonde, der indgår i andre fonde, som anført under post C0040. |
| C0120 | Afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsportefølje | <p>Angiv arten af den fond, der indgår i andre fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond</p> <p>2 — Matchtilpasningsportefølje</p> |

S.02.01 — Balance*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde og den resterende del.

Kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal udfyldes under anvendelse af værdiansættelsesprincipperne i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder udstedt i henhold til direktiv 2009/138/EF og EIOPA's retningslinjer.

Hvad angår kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) anvendes de indregnings- og værdiansættelsesmetoder, som koncernerne anvender i deres lovpligtige regnskaber i overensstemmelse med lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP. I skema SR.02.01 anvendes denne kolonne kun, hvis det i henhold til national lovgivning er et krav, at der udarbejdes regnskaber for ring-fenced fonde.

Hovedreglen er, at hver post skal indberettes særskilt i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi«. Der er imidlertid indsat stiplede rækker i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« for at muliggøre indberetning af aggregerede tal, hvis de individuelle tal ikke foreligger.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---------------------------------------|--|
| | <i>Aktiver</i> | |
| Z0020 | Ring-fenced fond eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fondsnummer | Hvis post Z0020 = 1, er dette et unikt fondsnummer eller en unik fondskode, som tildelt af selskabet. Det skal forblive uændret over tid. Det må ikke genanvendes til nogen anden fond. Hvis post Z0020 = 2, indberet »0«. |
| C0020/R0010 | Goodwill | Immaterielle aktiver, som opstår ved en virksomhedssammenslutning, og som repræsenterer den økonomiske værdi af aktiver, der ikke kan identificeres individuelt eller indregnes separat i en virksomhedssammenslutning. |
| C0020/R0020 | Udskudte anskaffelsesomkostninger | Anskaffelsesomkostninger, som vedrører kontrakter, der er i kraft på balancedatoen, og som overføres fra én indberetningsperiode til efterfølgende indberetningsperioder, i forbindelse med ikkeudløbne risikoperioder. I forbindelse med livsforsikringsvirksomhed udskydes anskaffelsesomkostninger, når det er sandsynligt, at de vil blive genindvundet. |
| C0010–C0020/R0030 | Immaterielle aktiver | Immaterielle aktiver, som ikke er goodwill. Et identificerbart, ikkemonetært aktiv uden fysisk substans. |
| C0010–C0020/R0040 | Udskudte skatteaktiver | Udskudte skatteaktiver er indkomstskatter, der i fremtidige regnskabsår vil reducere skattebetalinger som følge af: a) fradragsberettigede midlertidige forskelle b) fremførbare uudnyttede skattemæssige underskud og/eller c) fremførbare uudnyttede skattemæssige fradrag. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010–C0020/ R0050 | Pensionsmæssigt overskud | Det samlede nettooverskud relateret til medarbejdernes pensionsordning. |
| C0010–C0020/ R0060 | Materielle anlægsaktiver, som besiddes til eget brug | Materielle aktiver bestemt til permanent brug og ejendomme, der besiddes af selskabet til eget brug. Heri medregnes også ejendomme til eget brug under opførelse. |
| C0010–C0020/ R0070 | Investeringer (bortset fra aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler) | De samlede investeringer, undtagen aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler. |
| C0010–C0020/ R0080 | Ejendomme (bortset fra til eget brug) | Værdien af ejendomme (bortset fra til eget brug). Heri medregnes også ejendomme under opførelse bortset fra til eget brug. |
| C0010–C0020/ R0090 | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser | Kapitalinteresser som defineret i artikel 13, nr. 20), og artikel 212, stk. 2, og besiddelser i tilknyttede selskaber som defineret i artikel 212, stk. 1, litra b), i direktiv 2009/138/EF. Når dele af aktiverne i forbindelse med kapitalinteresser og tilknyttede selskaber vedrører unit-linked og indeksregulerede aftaler, skal disse dele indberettes under »Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler« i C0010—C0020/R0220. |
| C0010–C0020/ R0100 | Aktier | Aktier i alt, noterede og unoterede. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, angives under denne post summen. |
| C0010–C0020/ R0110 | Aktier — noterede | Kapitalandele, som repræsenterer selskabskapital, f.eks. ejerskabet i et selskab, og som handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, jf. direktiv 2004/39/EF. Heri medregnes ikke besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, indberettes denne post ikke. |
| C0010–C0020/ R0120 | Aktier — unoterede | Kapitalandele, som repræsenterer selskabskapital, f.eks. ejerskabet i et selskab, og som ikke handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, jf. direktiv 2004/39/EF. Heri medregnes ikke besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, indberettes denne post ikke. |
| C0010–C0020/ R0130 | Obligationer | Statsobligationer, erhvervsobligationer, strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer i alt. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling for obligationer, angives under denne post summen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|------------------------------------|---|
| C0010–C0020/ R0140 | Statsobligationer | <p>Obligationer udstedt af offentlige myndigheder, uanset om det er centralregeringer, overnationale regeringsinstitutioner, regionale regeringer eller lokale myndigheder, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, multilaterale udviklingsbanker omhandlet i artikel 117, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 eller internationale organisationer omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, regionale regeringer eller lokale myndigheder opført i artikel 1 i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, hvor garantien opfylder kravene i artikel 215 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0150 | Erhvervsobligationer | <p>Obligationer udstedt af selskaber</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0160 | Strukturerede værdipapirer | <p>Hybride værdipapirer, der kombinerer fastforrentede værdipapirer (med afkast i form af faste betalinger) med en række derivatkomponenter. Fastforrentede værdipapirer, der er udstedt af suveræne regeringer, er ikke omfattet af denne kategori. Vedrører værdipapirer, der omfatter enhver kategori af derivater, herunder credit default swaps (CDS'er), constant maturity swaps (CMS'er) og credit default optioner (CDO'er).</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0170 | Sikrede værdipapirer | <p>Værdipapirer, hvis værdi og betalinger er afledt af en portefølje af underliggende aktiver. Omfatter værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver (Asset Backed securities –ABS'er), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom (Mortgage Backed securities – MBS'er), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervs-ejendom (Commercial Mortgage Backed securities – CMBS'er), strukturerede kreditobligationer (Collateralised Debt Obligations – CDO'er), collateralised loan obligations (CLO'er) og collateralised mortgage obligations (CMO'er).</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0180 | Kollektive investeringsinstitutter | <p>Et »kollektivt investeringsinstitut«: et institut for kollektiv investering i værdipapirer (UCITS) som defineret i artikel 1, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF eller en alternativ investeringsfond (AIF) som defineret i artikel 4, stk. 1, litra a), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU.</p> |
| C0010–C0020/ R0190 | Derivater | <p>Et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | | <p>a) Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikke-finansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).</p> <p>b) Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.</p> <p>c) Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.</p> <p>Derivatets Solvens II-værdi på indberetningsdatoen indberettes kun her, hvis den er positiv (i tilfælde af negativ værdi, se R0790).</p> |
| C0010–C0020/ R0200 | Indskud, bortset fra likvider | Indskud, bortset fra likvider, som ikke kan anvendes til foretage betalinger inden en bestemt forfaldsdato, og som ikke kan konverteres til kontanter eller konverterbare indskud uden væsentlige begrænsninger eller sanktioner. |
| C0010–C0020/ R0210 | Øvrige investeringer | Øvrige investeringer, der ikke allerede er omfattet af ovenstående investeringer. |
| C0010–C0020/ R0220 | Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler (klassificeret som branche 31, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0010–C0020/ R0230 | Lån, herunder realkreditlån | <p>Lån, herunder realkreditlån, i alt, dvs. finansielle aktiver, der skabes, når selskaber udlåner midler, enten med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling for lån, herunder realkreditlån, angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/ R0240 | Policelån | <p>Lån ydet til forsikringstagere, sikret ved policer (underliggende forsikringsmæssige hensættelser).</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0250 | Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer | <p>Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer (fysiske personer) med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010–C0020/ R0260 | Andre lån, herunder realkreditlån | <p>Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer (øvrige, kan ikke klassificeres under post R0240 eller R0250), med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0270 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler fra: | <p>Beløb i alt, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Det svarer til genforsikringsandelen af forsikringsmæssige hensættelser (herunder finite reinsurance og SPV'er).</p> <p>For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) bør denne celle indeholde alle forventede betalinger fra genforsikringselskaber til selskabet (eller omvendt) svarende til betalinger, der endnu ikke er foretaget af selskabet til forsikringstagere (eller af forsikringstagere til selskabet). Forventede betalinger fra genforsikringselskaber til selskabet (eller omvendt) svarende til betalinger, der allerede er foretaget af selskabet til forsikringstagere (eller af forsikringstagere til selskabet), bør medregnes i tilgodehavender fra genforsikring (eller forpligtelser vedrørende genforsikring).</p> |
| C0010–C0020/ R0280 | Skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring | <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem skadesforsikring undtagen sygeforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring, angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/ R0290 | Skadesforsikring undtagen sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikringsvirksomhed, undtagen forsikringsmæssige hensættelser for sygeforsikring svarende til skadesforsikring. |
| C0010–C0020/ R0300 | Sygeforsikring svarende til skadesforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til skadesforsikring. |
| C0010–C0020/ R0310 | Livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked, og sygeforsikring svarende til livsforsikring, angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/ R0320 | Sygeforsikring svarende til livsforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0010–C0020/ R0330 | Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring, undtagen forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til livsforsikring og forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksregulerede og unit-linked aftaler. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010–C0020/ R0340 | Livsforsikring, indeksregule- rede og unit-linked aftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked livsforsikringsvirksomhed. |
| C0010–C0020/ R0350 | Indskud til cedenter | Indskud vedrørende accepteret genforsikring. |
| C0010–C0020/ R0360 | Tilgodehavender fra forsik- ringer og mæglere | Beløb, som skal betales af forsikringstagere og forsikringsselskaber og andre, og som er forbundet med forsikringsvirksomhed, der ikke er medregnet i de forsik- ringsmæssige hensættelser. Heri medregnes tilgodehavender fra accepteret genforsikring. |
| C0010–C0020/ R0370 | Tilgodehavender fra genforsik- ring | For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal denne celle indeholde alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genforsikringsselskaber —i tilknytning til genforsikringsvirksomhed — til selskabet, og som ikke er medregnet i beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Disse betalinger bør ikke indgå i posten »alle øvrige aktiver, ikke anført andet- steds« Denne celle bør især indeholde alle forventede betalinger fra genforsikringsssel- skaber til selskabet svarende til betalinger, der er foretaget af selskabet til forsik- ringstagere. Heri bør også indgå alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genfor- sikringsselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder eller begivenheder, som cedenten og genforsikringsselskabet er blevet enige om, og hvor beløbet for den forventede betaling er sikkert. |
| C0010–C0020/ R0380 | Tilgodehavender (handel, ikke forsikring) | Heri medregnes tilgodehavender fra ansatte eller handelspartnere (ikke forsikrings- relateret), herunder offentlige enheder. |
| C0010–C0020/ R0390 | Egne aktier (som besiddes direkte) | Egne aktier i alt, som besiddes direkte af selskabet. |
| C0010–C0020/ R0400 | Forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garantikapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt | Værdien af det forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garanti- kapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt. |
| C0010–C0020/ R0410 | Likvider | Pengesedler og mønter i omløb, som normalt anvendes til betalinger, og indskud, der på anfordring kan konverteres til kontanter til pari, og som er direkte anvend- elige til at foretage betalinger ved check, anvisning, girokort, direkte debitering/ kreditering eller lignende direkte betalingsfacilitet uden sanktioner eller begræns- ninger. Bankkonti må ikke modregnes; derfor indregnes kun positive konti under denne post, og kassekreditter skal anføres under forpligtelser, medmindre der er både en juridisk ret til modregning og en påviselig hensigt om at nettoafregne. |
| C0010–C0020/ R0420 | Alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds | Alle øvrige aktiver, der ikke allerede er anført andetsteds under balanceførte poster. |
| C0010–C0020/ R0500 | Aktiver i alt | Dette er den samlede værdi af alle aktiver. |
| | <i>Passiver</i> | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010–C0020/ R0510 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring | <p>Summen af de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> <p>Hvis det med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er muligt at foretage en opdeling af forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring mellem skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) og sygeforsikring svarende til skadesforsikring, angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/ R0520 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0530 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (eksklusive sygeforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (eksklusive sygeforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0540 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0550 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010–C0020/ R0560 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0570 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0010/R0580 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0590 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin vedrørende forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010–C0020/R0600 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | <p>Summen af de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> <p>Hvis det med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er muligt at foretage en opdeling af forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring (undtagen indeksreguleret og unit-linked) mellem sygeforsikring (svarende til livsforsikring) og livsforsikring (undtagen sygeforsikring, indeksreguleret og unit-linked), angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/R0610 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0620 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0630 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0640 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010–C0020/ R0650 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler) | De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler). Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010/R0660 | Forsikringsmæssige hensættelser — Livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) — Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (eksklusive sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler). Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010/R0670 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) — Bedste skøn | Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler). Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010/R0680 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler) — Risikomargin | Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler). Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010–C0020/ R0690 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked | De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010/R0700 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | De forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0010/R0710 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — Bedste skøn | Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed. Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0010/R0720 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — Risikomargin | Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |
| C0020/R0730 | Andre forsikringsmæssige hensættelser | Andre forsikringsmæssige hensættelser, som indregnet af selskaberne i deres lovpligtige regnskaber, i overensstemmelse med lokale GAAP eller IFRS. |
| C0010–C0020/R0740 | Eventualforpligtelser | En eventualforpligtelse defineres som: a) en mulig forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, hvis eksistens kun kan bekræftes ved, at der indtræffer eller ikke indtræffer en eller flere usikre fremtidige begivenheder, som ikke er under virksomhedens fulde kontrol, eller b) en aktuel forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, selv hvis: i) det ikke er sandsynligt, at indfrielse af forpligtelsen vil kræve et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer, eller ii) forpligtelsens størrelse ikke kan måles med tilstrækkelig pålidelighed. Eventualforpligtelser, der indregnes i balancen, skal opfylde kriterierne i artikel 11 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0010–C0020/R0750 | Hensættelser, som ikke er forsikringsmæssige hensættelser | Forpligtelser, hvis indfrielsestidspunkt eller størrelse er usikker, undtagen forpligtelser indberettet under »Pensionsforpligtelse«. Hensættelserne indregnes som forpligtelser (under forudsætning af at et pålideligt skøn kan foretages), når de repræsenterer forpligtelser, og det er sandsynligt at indfrielse af forpligtelserne vil medføre et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer. |
| C0010–C0020/R0760 | Pensionsforpligtelser | De samlede nettoforpligtelser relateret til medarbejdernes pensionsordning. |
| C0010–C0020/R0770 | Indskud fra genforsikringselskaber | Beløb (f.eks. kontanter) modtaget fra genforsikringselskaber eller fratrukket af genforsikringselskaber i henhold til genforsikringsaftalen. |
| C0010–C0020/R0780 | Udskudte skatteforpligtelser | Udskudte skatteforpligtelser er indkomstskatter, der i fremtidige regnskabsår vil blive betalbare som følge af skattepligtige midlertidige forskelle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010–C0020/ R0790 | Derivater | <p>Et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:</p> <p>a) Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikke-finansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).</p> <p>b) Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.</p> <p>c) Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.</p> <p>Kun derivatforpligtelser indberettes i denne række (dvs. derivater med negative værdier på indberetningsdatoen). Derivataktiver offentliggøres under C0010 — C0020/R0190.</p> <p>Selskaber, der ikke værdiansætter derivater i deres lokale GAAP, behøver ikke anføre en regnskabsmæssig værdi.</p> |
| C0010–C0020/ R0800 | Gæld til kreditinstitutter | Gæld, f.eks. realkreditlån og andre lån, til kreditinstitutter, undtagen obligationer, der besiddes af kreditinstitutter (da det er ikke muligt for koncernen at angive alle indehavere af de obligationer, der udstedes) og efterstillet gæld. Kassekreditter medregnes. |
| C0010–C0020/ R0810 | Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter | <p>Finansielle forpligtelser, herunder obligationer udstedt af selskabet (uanset om de besiddes af kreditinstitutter eller ej), strukturerede værdipapirer udstedt af selskabet selv og realkreditlån og andre lån til andre enheder end kreditinstitutter.</p> <p>Efterstillet gæld medregnes ikke her.</p> |
| C0010–C0020/ R0820 | Forpligtelser vedrørende forsikringer og mæglere | <p>Beløb, der skal betales til forsikringstagere, forsikringsselskaber og anden virksomhed, forbundet med forsikring, men som ikke er medtaget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Heri medregnes forpligtelser over for (gen)forsikringsmæglere (f.eks. mæglerprovisioner, der er forfaldne, men endnu ikke betalt af selskabet).</p> <p>Heri medregnes ikke forfaldne låneforpligtelser, herunder i form af realkreditlån, over for andre forsikringsselskaber, hvis de kun vedrører finansiering og ikke er forbundet med forsikringsvirksomhed (sådanne lån, herunder realkreditlån, skal indberettes som finansielle forpligtelser).</p> <p>Heri medregnes forpligtelser vedrørende accepteret genforsikring.</p> |
| C0010–C0020/ R0830 | Forpligtelser vedrørende genforsikring | <p>Andre forpligtelser over for genforsikringsselskaber (især anfordringskonti) end indskud forbundet med genforsikringsvirksomhed, der ikke er medtaget i beløb, der kan tilbagekræves, herunder forpligtelser fra selskabet over for genforsikringsselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder.</p> <p>Heri medregnes forpligtelser over for genforsikringsselskaber vedrørende cederede præmier.</p> <p>For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal denne celle indeholde alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra selskabet til genforsikringsselskaber, som ikke er medregnet i beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Disse betalinger bør ikke indgå i posten »alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds«</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| | | <p>Denne celle bør især indeholde alle forventede betalinger fra selskabet til genforsikringsselskaber, som svarer til betalinger, der er foretaget af forsikringstagere til selskabet.</p> <p>Heri bør også indgå alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genforsikringsselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder eller begivenheder, som cedenten og genforsikringsselskabet er blevet enige om, og hvor beløbet for den forventede betaling er sikkert.</p> |
| C0010–C0020/ R0840 | Forpligtelser (handel, ikke forsikring) | Handelsforpligtelser i alt, herunder beløb til ansatte, leverandører osv., som ikke er forbundet med forsikring, parallelt med tilgodehavender (handel, ikke forsikring) på aktivsiden; omfatter også offentlige enheder. |
| C0010–C0020/ R0850 | Efterstillet gæld | <p>Efterstillet gæld er gæld, der er efterstillet anden specificeret gæld, når selskabet likvideres. Efterstillet gæld, der er klassificeret som basiskapitalgrundlag, og efterstillet gæld, der ikke er medregnet i basiskapitalgrundlaget, i alt.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, angives under denne post summen.</p> |
| C0010–C0020/ R0860 | Efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget | <p>Efterstillet gæld er gæld, der er efterstillet anden specificeret gæld, når selskabet likvideres. Anden gæld kan være endnu mere efterstillet. Kun efterstillet gæld, der ikke er klassificeret som basiskapitalgrundlag, anføres her.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0870 | Efterstillet gæld medregnet i basiskapitalgrundlaget | <p>Efterstillet gæld klassificeret som basiskapitalgrundlag.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i kapitalgrundlaget og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010–C0020/ R0880 | Alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds | Alle øvrige passiver, der ikke allerede er anført andetsteds under balanceførte poster. |
| C0010–C0020/ R0900 | Passiver i alt | Alle passiver i alt. |
| C0010/R1000 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Selskabets samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, som værdiansat i henhold til Solvens II-værdiansættelsesgrundlaget. Værdi af aktiver minus passiver. |
| C0020/R1000 | Overskydende aktiver i forhold til passiver (regnskabsmæssig værdi) | Den samlede værdi i »Overskydende aktiver i forhold til passiver« i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi«. |

S.02.02 — Passiver efter valuta

Generel bemærkning:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal udfyldes i overensstemmelse med balancen (S.02.01). Der er fastsat værdiansættelsesprincipper i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder og retningslinjer vedrørende Solvens II.

Dette skema skal ikke indgives, hvis én enkelt valuta tegner sig for mere end 80 % af passiverne. Hvis værdien af de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0030 og R0120 i S.12.01 og R0060 og R0160 i S.17.01, er negativ, skal den absolutte værdi af disse notionelle værdier i forbindelse med beregningen af ovennævnte tærskel tages i betragtning uden fradrag af de forsikringsmæssige hensættelser mellem de forskellige brancher.

Hvis det indgives, skal der altid indberettes oplysninger om indberetningsvalutaen, uanset værdien af passiver. Oplysninger indberettet efter valuta skal som minimum tegne sig for 80 % af de samlede passiver. De resterende 20 % kan lægges sammen. Hvis en bestemt valuta skal anvendes i indberetningen til opfyldelse af tærsklen på 80 %, anvendes denne valuta i indberetningen af alle passiver.

Captive-selskaber er fritaget for at indberette dette skema.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0010 | Væsentlig valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for hver valuta, som indberettes. |
| C0020/R0110 | Samlet værdi for alle valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet den samlede værdi af de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for alle valutaer. |
| C0030/R0110 | Værdi for indberetningsvalutaen — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0110 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet den samlede værdi af forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0110) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0110). |
| C0050/R0110 | Værdi for væsentlige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0120 | Samlet værdi for alle valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet den samlede værdi af de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for alle valutaer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0030/R0120 | Værdi for indberetningsvalutaen — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0120 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0120) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0120). |
| C0050/R0120 | Værdi for væsentlige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0130 | Samlet værdi for alle valutaer — Indskud fra genforsikrings-selskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet den samlede værdi af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for alle valutaer. |
| C0030/R0130 | Værdi for indberetningsvalutaen — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0130 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0130) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0130). |
| C0050/R0130 | Værdi for væsentlige valutaer — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0140 | Samlet værdi for alle valutaer — Derivater | Indberet den samlede værdi af derivaterne for alle valutaer. |
| C0030/R0140 | Værdi for indberetningsvalutaen — Derivater | Indberet værdien af derivaterne for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0140 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Derivater | Indberet den samlede værdi af derivater for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0140) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0140). |
| C0050/R0140 | Værdi for væsentlige valutaer — Derivater | Indberet værdien af derivaterne for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0020/R0150 | Samlet værdi for alle valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet den samlede værdi af de finansielle forpligtelser for alle valutaer. |
| C0030/R0150 | Værdi for indberetningsvalutaen — Finansielle forpligtelser | Indberet værdien af de finansielle forpligtelser for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0150 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet den samlede værdi af de finansielle forpligtelser for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0150) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0150). |
| C0050/R0150 | Værdi for væsentlige valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet værdien af de finansielle forpligtelser for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0160 | Samlet værdi for alle valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet den samlede værdi af eventualforpligtelserne for alle valutaer. |
| C0030/R0160 | Værdi for indberetningsvalutaen — Eventualforpligtelser | Indberet værdien af eventualforpligtelserne for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0160 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet den samlede værdi af eventualforpligtelserne for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0160) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0160). |
| C0050/R0160 | Værdi for væsentlige valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet værdien af eventualforpligtelserne for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0170 | Samlet værdi for alle valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet den samlede værdi af alle øvrige passiver for alle valutaer. |
| C0030/R0170 | Værdi for indberetningsvalutaen — Alle øvrige passiver | Indberet værdien af alle øvrige passiver for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0170 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet den samlede værdi af alle øvrige passiver for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0170) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0170). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0050/R0170 | Værdi for væsentlige valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet værdien af alle øvrige passiver for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0200 | Samlet værdi for alle valutaer — Samlede passiver | Indberet den samlede værdi af de samlede passiver for alle valutaer. |
| C0030/R0200 | Værdi for indberetningsvalutaen — Samlede passiver | Indberet værdien af de samlede passiver for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0200 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Samlede passiver | Indberet den samlede værdi af de samlede passiver for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0200) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0200). |
| C0050/R0200 | Værdi for væsentlige valutaer — Samlede passiver | Indberet værdien af de samlede passiver for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |

5.03.01 — Ikkebalanceførte poster — Generelt

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette afsnit indeholder oplysningerne om ikkebalanceførte poster samt den maksimale værdi og Solvens II-værdien af eventualforpligtelser på Solvens II-balancen.

En aktiepulje, som sikrer en investering (f.eks. den aktiepulje, der er sikkerhed for dækkede obligationer), indberettes ikke i dette skema.

Hvad angår Solvens II-værdien defineres posterne i vejledningen ud fra en indregningstilgang. Der er fastsat værdiansættelsesprincipper i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35, tekniske standarder udstedt i henhold til direktiv 2009/138/EF samt EIOPA-retningslinjer.

Garantier kræver, at udsteder betaler bestemte beløb som godtgørelse til indehaver for et tab, som denne pådrager sig, hvis en bestemt debitor ikke foretager rettidig betaling i henhold til de oprindelige eller ændrede vilkår for et gældsinstrument. Disse garantier kan antage forskellige juridiske former, såsom finansielle garantier, rembuser og kreditmisligholdelseskontrakter. I disse poster medregnes ikke garantier hidrørende fra forsikringsaftaler, som er indregnet i forsikringsmæssige hensættelser.

En eventualforpligtelse defineres som:

- a) en mulig forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, hvis eksistens kun kan bekræftes ved, at der indtræffer eller ikke indtræffer en eller flere usikre fremtidige begivenheder, som ikke er under virksomhedens fulde kontrol, eller
- b) en aktuel forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, selv hvis:
 - i. det ikke er sandsynligt, at indfrielse af forpligtelsen vil kræve et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer, eller
 - ii. forpligtelsens størrelse ikke kan måles med tilstrækkelig pålidelighed.

Sikkerhedsstillelse er et aktiv med en monetær værdi eller en forpligtelse, der sikrer långiveren, i tilfælde af at låntageren misligholder sin forpligtelse. Værdien af denne sikkerhed skal indberettes som økonomisk værdi for sikkerheden pr. referencedato (Solvens II-værdi for aktiverne), og ikke som den risikostregerede værdi af en sikkerhed i henhold til den delegerede forordnings artikel 197.

Kun begrænsede garantier indberettes i dette skema, eksklusivt oplysninger om stillede eller modtagne ubegrænsede garantier.

Dette skema indberettes, når en hvilken som helst af de følgende betingelser gælder:

a) værdien af enhver af de følgende sammenlægninger overstiger 2 % af de samlede aktiver:

- i. (C0020/R0010) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder rembursen + (C0020/R0300) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed + (C0010/R0400) Maksimalværdi — Eventualforpligtelser i alt
- ii. (C0020/R0030) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier modtaget af selskabet, herunder rembursen + (C0020/R0200) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet sikkerhed, der besiddes, eller

b) selskabet har givet eller modtaget en ubegrænset garanti.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0010 | Maksimal værdi — Garantier stillet af selskabet, herunder rembursen | Summen af hele det mulige likviditetstab forbundet med garantier, hvis de hændelser, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier stillet af selskabet til en anden part. Heri medregnes cash flow i forbindelse med rembursen. Hvis en garanti også angives som eventualforpligtelse under R0310, medregnes den maksimale værdi også i denne række. |
| C0010/R0020 | Maksimal værdi — Garantier stillet af selskabet, herunder rembursen, heraf garantier, herunder rembursen stillet til andre selskaber i samme koncern | Del af C0010/R0010 vedrørende garantier, herunder rembursen, stillet til andre selskaber i den samme koncern. |
| C0020/R0010 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — garantier stillet af selskabet, herunder rembursen | Solvens II-værdi af garantier stillet af selskabet, herunder rembursen. |
| C0020/R0020 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — garantier stillet af selskabet, herunder rembursen, heraf garantier, herunder rembursen stillet til andre selskaber i samme koncern | Del af C0020/R0010 vedrørende garantier, herunder rembursen, stillet til andre selskaber i den samme koncern. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0030 | Maksimal værdi — garantier modtaget af selskabet, herunder remburs | Summen af hele den mulige likviditetstilførsel forbundet med garantier, hvis de hændelser, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier modtaget af selskabet fra en anden part som sikkerhed for betaling af selskabets forpligtelser (heri medregnes remburs og uudnyttede lånefaciliteter). |
| C0010/R0040 | Maksimal værdi — garantier modtaget af selskabet, herunder remburs, heraf garantier, herunder remburs modtaget fra andre selskaber i samme koncern | Del af C0010/R0030 vedrørende garantier, herunder remburs, modtaget fra andre selskaber i den samme koncern. |
| C0020/R0030 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — garantier modtaget af selskabet, herunder remburs | Solvens II-værdi af garantier modtaget af selskabet, herunder remburs. |
| C0020/R0040 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — garantier modtaget af selskabet, herunder remburs, heraf garantier, herunder remburs modtaget fra andre selskaber i samme koncern | Del af C0020/R0030 vedrørende garantier, herunder remburs, modtaget fra andre selskaber i den samme koncern. |
| C0020/R0100 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer. |
| C0020/R0110 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed, der besiddes for derivater | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for derivater. |
| C0020/R0120 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser | Solvens II-værdi af aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0020/R0130 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Anden sikkerhed, der besiddes | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for derivater. |
| C0020/R0200 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet sikkerhed, der besiddes | Samlet Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes. |
| C0030/R0100 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed for ydede lån eller købte obligationer. |
| C0030/R0110 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Sikkerhed, der besiddes for derivater | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed for derivater. |
| C0030/R0120 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser | Solvens II-værdi af de aktiver, der er stillet som sikkerhed af genforsikringselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0030/R0130 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Anden sikkerhed, der besiddes | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes anden sikkerhed. |
| C0030/R0200 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Samlet sikkerhed, der besiddes | Samlet Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke den samlede sikkerhed besiddes. |
| C0020/R0210 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer | Solvens II-værdi af den sikkerhed, der er stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer. |
| C0020/R0220 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed stillet for derivater | Solvens II-værdi af sikkerhed stillet for derivater. |
| C0020/R0230 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Aktiver stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring) | Solvens II-værdi af de aktiver, der er stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0020/R0240 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Anden stillet sikkerhed | Solvens II-værdi af sikkerhed stillet for anden sikkerhedsstillelse. |
| C0020/R0300 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed | Samlet Solvens II-værdi af den stillede sikkerhed. |
| C0040/R0210 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Stillet sikkerhed for modtagne lån eller udstedte obligationer | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed for modtagne lån eller udstedte obligationer. |
| C0040/R0220 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Sikkerhed stillet for derivater | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed for derivater. |
| C0040/R0230 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Aktiver stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring) | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke aktiverne er stillet som sikkerhed for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). |
| C0040/R0240 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Anden stillet sikkerhed | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet anden sikkerhed. |
| C0040/R0300 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Samlet stillet sikkerhed | Samlet Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke sikkerheden er stillet. |
| C0010/R0310 | Maksimal værdi — Eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen | <p>Størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidigt likviditetstab, der er nødvendigt for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der ikke er omfattet af de på Solvens II-balancen værdiansatte eventualforpligtelser (post C0010/R0740 i S.02.01).</p> <p>Dette vedrører eventualforpligtelser, der ikke er væsentlige.</p> <p>I værdien skal medregnes garantier indberettet under R0010, hvis de regnes for eventualforpligtelser.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0320 | Maksimal værdi — eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen, heraf eventualforpligtelser over for enheder i samme koncern | Del af C0010/R0310 vedrørende eventualforpligtelser over for enheder i den samme koncern. |
| C0010/R0330 | Maksimal værdi — Eventualforpligtelser på Solvens II-balancen | Størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidigt likviditetstab, der er nødvendigt for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der er indregnet i Solvens II-balancen, som fastsat i artikel 11 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0010/R0400 | Maksimal værdi — Samlede eventualforpligtelser | Samlede størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidige cash flow, der er nødvendige for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser. |
| C0020/R0310 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Eventualforpligtelser ikke på Solvens II-balancen | Solvens II-værdi af de eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen. |
| C0020/R0330 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Eventualforpligtelser på Solvens II-balancen | Solvens II-værdi af eventualforpligtelserne på Solvens II-balancen. Denne værdi indberettes kun i forbindelse med eventualforpligtelser, for hvilke der er indberettet en værdi under post C0010/R0330 i S.03.01. Hvis denne værdi er lavere end C0010/R0740 i S.02.01, skal der gives en forklaring i den beskrivende del af indberetningen. |
| C0050/R0510 | Ubegrænsede garantier — modtaget | Angivelse af, om selskabet har modtaget ubegrænsede garantier. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 0 — Ingen modtagne ubegrænsede garantier 1 — Ubegrænsede garantier, kun modtaget af enheder i samme koncern 2 — Ubegrænsede garantier, kun modtaget af enheder, der ikke tilhører samme koncern 3 — Ubegrænsede garantier, modtaget af enheder i samme koncern og af enheder, der ikke tilhører samme koncern |
| C0050/R0520 | Ubegrænsede garantier — stillet | Angivelse af, om selskabet har stillet ubegrænsede garantier. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 0 — Ingen stillede ubegrænsede garantier 1 — Ubegrænsede garantier, kun stillet til enheder i samme koncern |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|---|
| | | 2 — Ubegrænsede garantier, kun stillet til enheder, der ikke tilhører samme koncern 3 — Ubegrænsede garantier, stillet til enheder i samme koncern og til enheder, der ikke tilhører samme koncern |

S.04.02 — Oplysninger om forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til Solvens II-direktivet, undtagen fragtførerens ansvar

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal indberettes i overensstemmelse med artikel 159 i direktiv 2009/138/EF og vedrører kun direkte forsikringsvirksomhed.

Der skal indberettes oplysninger vedrørende virksomhed i henhold til reglerne om den frie udveksling af tjenesteydelser udøvet af selskabet, idet udøvet virksomhed efter filial og i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser anføres separat.

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------|--|--|
| R0010 ... | EØS-land | ISO 3166-1 alpha-2-koden for det EØS-land, hvor filialen befinder sig. |
| C0010/R0020 | Selskab — Fri udveksling af tjenesteydelser — Hyppighed af krav vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Antallet af krav, i forbindelse med den af selskabet udøvede forsikringsvirksomhed i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), i forhold til det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer i indberetningsperioden. Det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer beregnes som et gennemsnit af antallet af forsikrede køretøjer ved regnskabsårets udgang og antallet af forsikrede køretøjer ved udgangen af året før indberetningsåret. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |
| C0010/R0030 | Selskab — Fri udveksling af tjenesteydelser — Gennemsnitlige erstatningsudgifter vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Gennemsnitlige erstatningsudgifter, i forbindelse med den af selskabet udøvede forsikringsvirksomhed i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), målt som erstatningsudgifternes størrelse divideret med antallet af krav. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |
| C0020/R0020 | Filial — Hyppighed af krav vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Antallet af krav, for hver filial i forbindelse med den forsikringsvirksomhed, der udøves i det land, hvor filialen er etableret, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), over det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer i indberetningsperioden. Det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer beregnes som et gennemsnit af antallet af forsikrede køretøjer ved regnskabsårets udgang og antallet af forsikrede køretøjer ved udgangen af året før indberetningsåret. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|--|--|
| C0030/R0020 | Fri udveksling af tjenesteydelser — Hyppighed af krav vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Antallet af krav, for hver filial i forbindelse med den i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser udøvede forsikringsvirksomhed, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), over det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer i indberetningsperioden. Det gennemsnitlige antal forsikrede køretøjer beregnes som et gennemsnit af antallet af forsikrede køretøjer ved regnskabsårets udgang og antallet af forsikrede køretøjer ved udgangen af året før indberetningsåret. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |
| C0020/R0030 ... | Filial — Gennemsnitlige erstatningsudgifter vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Gennemsnitlige erstatningsudgifter, for hver filial i forbindelse med den forsikringsvirksomhed, der udøves i det land, hvor filialen er etableret, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), målt som erstatningsudgifternes størrelse divideret med antallet af krav. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |
| C0030/R0030 ... | Fri udveksling af tjenesteydelser — Gennemsnitlige erstatningsudgifter vedrørende motoransvarsforsikring (undtagen fragtførerens ansvar) | Gennemsnitlige erstatningsudgifter, for hver filial i forbindelse med den i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser udøvede forsikringsvirksomhed, med hensyn til forsikringsklasse 10 i del A i bilag I til direktiv 2009/138/EF (undtagen fragtførerens ansvar), målt som erstatningsudgifternes størrelse divideret med antallet af krav. Der tages ikke hensyn til krav uden udbetalinger. |

S.04.03 — Grundlæggende oplysninger — liste over forsikringsudbydende enheder

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører kun den årlige indberetning af oplysninger for individuelle forsikrings- og genforsikringselskaber.

Vejledningerne om indberetning for skema S.04.03 skal læses sammenholdt med vejledningerne for S.04.04 og S.04.05. I disse tre skemaer skal enhederne indberette al virksomhed set ud fra to forskellige perspektiver: det sted, hvor forsikringen tegnes, og det sted, hvor risikoen befinder sig.

Oplysningerne i disse skemaer skal omfatte:

- al forsikringsvirksomhed, uanset om der anvendes en eventuel forskellig klassificering af investeringsaftaler og forsikringsaftaler i regnskabet. og
- direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed.

Dette skema skal indberettes ud fra en regnskabsmæssig tilgang, (dvs. lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP), det skal dog udfyldes under anvendelse af brancherne som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Selskaber skal anvende samme værdiansættelses- og indregningsgrundlag som for de offentliggjorte regnskaber (dvs. der kræves ingen ny indregning eller værdiansættelse) med undtagelse af klassificeringen mellem investeringsaftaler og forsikringsaftaler, når dette anvendes i regnskabet.

Oplysningerne i disse skemaer angives brutto, uden fradrag af cederet genforsikring.

I dette skema forstås ved »etableringsland«:

- a) det land, hvor forsikringselskabet er meddelt tilladelse (hjemland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial, og

b) det land, hvor filialen er beliggende (værtland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial

I dette skema anses en mægler ikke for at være en særskilt forsikringsudbydende enhed. Hvis der blev anvendt en mægler, eller i enhver anden situation, er etableringslandet enten a) eller b), afhængigt af hvem der solgte kontrakten.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Liste over forsikringsudbydende enheder

| | | |
|-------|--|---|
| C0010 | Kode for den forsikringsudbydende enhed | <p>Identifikationskoden for den forsikringsudbydende enhed er LEI-koden for hovedkontoret. Hvis en filial i et ikke-EØS-land har en LEI-kode, der er forskellig fra hovedkontorets kode, anvendes denne LEI-kode som kode for den forsikringsudbydende enhed.</p> <p>For filialer i EØS-lande og i ikke-EØS-lande, som ikke har en særskilt LEI-kode, tildeler selskabet en specifik kode. En sådan kode skal være unik for den specifikke forsikringsudbydende enhed og må ikke overlappe i forhold til andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden.</p> |
| C0011 | Kode for type forsikringsudbydende enhed | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Kode for forsikringsudbydende enhed«.</p> <p>1 — LEI-kode 2 — Specifik kode</p> |
| C0020 | Type enhed | <p>Identifikation af type enhed Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Hovedkontor 2 — Filial</p> |
| C0030 | Lokalisering af type filial | <p>Identifikation af type filial Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — EØS-filial 2 — Ikke-EØS-filial</p> <p>Hvis »type enhed« er angivet som hovedkontor i C0020, udfyldes dette felt ikke.</p> |
| C0040 | Etableringsland | <p>Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for etableringslandet for den enkelte filial.</p> <p>Dette felt er ikke relevant (i dette skema), hvis der er valgt »hovedkontor« i C0020, da landekoden i dette tilfælde er defineret som »det land, hvor tilladelsen er meddelt«, indberettet i skema S.01.02</p> |

S.04.04 — Aktivitet efter land — det sted, hvor forsikringen tegnes

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører kun den årlige indberetning af oplysninger for individuelle forsikrings- og genforsikringselskaber.

Vejledningerne om indberetning for skema S.04.04 skal læses sammenholdt med vejledningerne for S.04.03 og S.04.05. I disse tre skemaer skal enhederne indberette al virksomhed set ud fra to forskellige perspektiver: det sted, hvor forsikringen tegnes, og det sted, hvor risikoen befinder sig. I skema S.04.04 er der fokus på det sted, hvor forsikringen tegnes.

Oplysningerne indberettes, idet der skelnes mellem forsikringsvirksomhed indgået i det land, hvor de enkelte forsikringsudbydende enheder er etableret (som anført i skema S.04.03), og forsikringsvirksomhed indgået i de enkelte lande tilhørende EØS i henhold til principperne om fri udveksling af tjenesteydelser for den enkelte forsikringsudbydende enhed.

Enhver forsikringsvirksomhed indgået af en forsikringsudbydende enhed, og som ikke er indgået i henhold til principperne om fri udveksling af tjenesteydelser, klassificeres som forsikringsvirksomhed indgået i det land, hvor den forsikringsudbydende enhed er etableret.

Sammenlægning af enhver række under C0030 for alle berørte lande skal stemme overens med den værdi, der er angivet i C0020 for den samme række.

Forsikrings- og genforsikringsselskaber indberetter tegnede præmier/præmieindtægter som defineret i artikel 1, nr. 11) og 12), i delegeret forordning (EU) 2015/35, uanset om der er anvendt lokal GAAP eller IFRS.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Efter forsikringsudbydende enhed

| | | |
|-------|---------|--|
| Z0010 | Branche | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring 21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring 22 — Proportional retshjælpsgenforsikring 23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance |
|-------|---------|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | | <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring.</p> <p>29 — Sygeforsikring</p> <p>30 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> <p>32 — Anden livsforsikring</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livsforsikring.</p> |
| Z0020 | Kode for den forsikringsudbydende enhed | Identifikationskoden for den enkelte forsikringsudbydende enhed som indberettet i skema S.04.03. |
| C0010/R0020 | Forsikringsvirksomhed indgået i etableringslandet — tegnede præmier (brutto) | <p>Tegnede præmier for den enkelte forsikringsudbydende enhed i etableringslandet</p> <p>Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler, uafhængigt af om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår.</p> <p>Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier.</p> |
| C0010/R0030 | Forsikringsvirksomhed indgået i etableringslandet — erstatningsudgifter | <p>Erstatningsudgifter for den enkelte forsikringsudbydende enhed i etableringslandet</p> <p>Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler.</p> <p>I beløbet for erstatningsudgifter medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0040 | Forsikringsvirksomhed indgået i etableringslandet — anskaffelsesomkostninger | <p>Anskaffelsesomkostninger for den enkelte forsikringsudbydende enhed i etableringslandet</p> <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi enheden har indgået den pågældende aftale. Denne post indberettes inklusive fornyelsesomkostninger.</p> <p>Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en indgået forsikringsaftale. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger, hvis relevant.</p> |
| C0010/R0050 | Forsikringsvirksomhed indgået i etableringslandet — anskaffelsesomkostninger inklusive provisioner | <p>Provisioner for den enkelte forsikringsudbydende enhed i etableringslandet</p> <p>Den del af de samlede anskaffelsesomkostninger (som indberettet i R0040), som vedrører provisionsomkostninger.</p> |
| C0020/R0020 | Forsikringsvirksomhed indgået via fri udveksling af tjenesteydelser i et andet land end etableringslandet — tegnede præmier (brutto) | <p>Tegnede præmier opnået ved fri udveksling af tjenesteydelser i ethvert andet land end etableringslandet for den enkelte forsikringsudbydende enhed.</p> <p>Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler, uafhængigt af om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår.</p> <p>Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier.</p> |
| C0020/R0030 | Forsikringsvirksomhed indgået via fri udveksling af tjenesteydelser i et andet land end etableringslandet — erstatningsudgifter | <p>Erstatningsudgifter opnået ved fri udveksling af tjenesteydelser i ethvert andet land end etableringslandet for den enkelte forsikringsudbydende enhed.</p> <p>Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler.</p> <p>I beløbet for erstatningsudgifter medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0020/R0040 | Forsikringsvirksomhed indgået via fri udveksling af tjenesteydelser i et andet land end etableringslandet — anskaffelsesomkostninger | <p>Anskaffelsesomkostninger opnået ved fri udveksling af tjenesteydelser i ethvert andet land end etableringslandet for den enkelte forsikringsudbydende enhed.</p> <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi enheden har indgået den pågældende aftale. Denne post indberettes inklusive fornyelsesomkostninger.</p> <p>Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en indgået forsikringsaftale. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger, hvis relevant.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0020/R0050 | Forsikringsvirksomhed indgået via fri udveksling af tjenesteydelser i et andet land end etableringslandet — anskaffelsesomkostninger inklusive provisioner | Provisioner opnået ved fri udveksling af tjenesteydelser i ethvert andet land end etableringslandet for den enkelte forsikringsudbydende enhed. Den del af de samlede anskaffelsesomkostninger (som indberettet i R0040), som vedrører provisionsomkostninger. |

Efter forsikringsudbydende enhed og efter EØS-land (lokalisering af aktivitet [baseret på det sted, hvor forsikringsvirksomheden er indgået])

| | | |
|-------------|---|--|
| R0010 | EØS-land | ISO 3166-1 alpha-2-koden for det EØS-land, hvor forsikringsvirksomheden forsikres gennem fri udveksling af tjenesteydelser. |
| C0030/R0020 | Forsikringsvirksomhed indgået i det berørte land via fri udveksling af tjenesteydelser — tegnede præmier (brutto) | Tegnede præmier for den enkelte forsikringsudbydende enhed opstået ved fri udveksling af tjenesteydelser i EØS-landet, indberettet i R0010. Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler, uafhængigt af om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0030 | Forsikringsvirksomhed indgået i det berørte land via fri udveksling af tjenesteydelser — erstatningsudgifter | Erstatningsudgifter for den enkelte forsikringsudbydende enhed opstået ved fri udveksling af tjenesteydelser i EØS-landet, indberettet i R0010. Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler. I beløbet for erstatningsudgifter medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0030/R0040 | Forsikringsvirksomhed indgået i det berørte land via fri udveksling af tjenesteydelser — anskaffelsesomkostninger | Anskaffelsesomkostninger for den enkelte forsikringsudbydende enhed opstået ved fri udveksling af tjenesteydelser i EØS-landet, indberettet i R0010. Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi enheden har indgået den pågældende aftale. Denne post indberettes inklusive fornyelsesomkostninger. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en indgået forsikringsaftale. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger, hvis relevant. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0030/R0050 | Forsikringsvirksomhed indgået i det berørte land via fri udveksling af tjenesteydelser — anskaffelsesomkostninger inklusive provisioner | Provisioner for den enkelte forsikringsudbydende enhed opstået ved fri udveksling af tjenesteydelser i EØS-landet, indberettet i R0010. Den del af de samlede anskaffelsesomkostninger (som indberettet i R0040), som vedrører provisionsomkostninger. |

S.04.05 — Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører kun den årlige indberetning af oplysninger for individuelle forsikrings- og genforsikringsselskaber.

Vejledningerne om indberetning for skema S.04.05 skal læses sammenholdt med vejledningerne for S.04.03 og S.04.04. I disse tre skemaer skal enhederne indberette al virksomhed set ud fra to forskellige perspektiver: det sted, hvor forsikringen tegnes, og det sted, hvor risikoen befinder sig. I skema S.04.05 fokuseres der på det sted, hvor risikoen befinder sig.

I dette skema og ved direkte forsikring forstås ved »land, hvor risikoen består«:

- a) for forsikringer, der vedrører enten bygninger eller bygninger inklusive indhold, for så vidt som indholdet er omfattet af samme forsikringspolice, det land, hvor ejendommen befinder sig,
- b) for forsikringer, der vedrører køretøjer af enhver art, registreringslandet
- c) for policer af en varighed på højst fire måneder, som omfatter risici i forbindelse med rejser eller ferie, uanset forsikringsklasse, det land, hvor forsikringstageren indgik forsikringspolice
- d) for forsikringer, der vedrører kreditter eller tilgodehavender, det land, hvor kreditten eller tilgodehavendet befinder sig
- e) i alle tilfælde, der ikke eksplicit er omfattet af litra a), b), c) eller d), det land, hvor et af følgende er beliggende:
 - i. forsikringstagers sædvanlige bopæl eller
 - ii. hvis forsikringstager er en juridisk person dennes etableringssted, som er omhandlet i aftalen.

I dette skema og ved proportional eller ikkeproportional genforsikring forstås ved »land, hvor risikoen består«, det land, hvor det cederende selskab befinder sig,

Selskaber indberetter for hvert enkelt land for mindst 95 % af de tegnede bruttopræmier. Al virksomhed indberettes, dog kan enhver resterende virksomhed over tærsklen på 95 % samles under »øvrige lande«.

Forsikrings- og genforsikringsselskaber indberetter tegnede præmier/præmieindtægter som defineret i artikel 1, nr. 11) og 12), i delegeret forordning (EU) 2015/35, uanset om der er anvendt lokal GAAP eller IFRS.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Samlet aktivitet for den forsikringsudbydende enhed

| | | |
|-------|---------|---|
| Z0010 | Branche | Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskedeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring |
|-------|---------|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | | 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring 21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring 22 — Proportional retshjælp/genforsikring 23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance 24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. 28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring. 29 — Sygeforsikring 30 — Forsikring med gevinstandele 31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring 32 — Anden livsforsikring 33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser 34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser 35 — Sygegenforsikring 36 — Livsgenforsikring. |
| Z0020 | Kode for den forsikringsudbydende enhed | Identifikationskoden for den enkelte forsikringsudbydende enhed som indberettet i skema S.04.03. |
| C0010/R0020 | Den samlede virksomhed indgået af selskaberne — tegnede præmier (brutto) | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler, uafhængigt af om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0030 | Den samlede virksomhed indgået af selskaberne — tegnede præmier (brutto) | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser. |
| C0010/R0040 | Den samlede virksomhed indgået af selskaberne — erstatningsudgifter (brutto) | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler. I beløbet for erstatningsudgifter medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010/R0050 | Den samlede virksomhed indgået af selskaberne — omkostninger (brutto) | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som selskabet har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |

Aktivitet efter land — det sted, hvor risikoen befinder sig

| | | |
|-------------|--|--|
| R0010 | Land | ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor risikoen består |
| C0020/R0020 | Samlet aktivitet efter land — tegnede præmier (brutto) | Tegnede bruttopræmier for den forsikringsvirksomhed, hvor risikoen befinder sig i det land, der er indberettet under R0010. Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler, uafhængigt af om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0030 | Samlet aktivitet efter land — præmieindtægter (brutto) | Bruttopræmieindtægter for den forsikringsvirksomhed, hvor risikoen befinder sig i det land, der er indberettet under R0010. Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser. |
| C0020/R0040 | Samlet aktivitet efter land — erstatningsudgifter (brutto) | Bruttoerstatningsudgifter for den forsikringsvirksomhed, hvor risikoen befinder sig i det land, der er indberettet under R0010. Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler. I beløbet for erstatningsudgifter medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0020/R0050 | Samlet aktivitet efter land — omkostninger (brutto) | Bruttoomkostninger for den forsikringsvirksomhed, hvor risikoen befinder sig i det land, der er indberettet under R0010. Alle forsikringsmæssige omkostninger, som selskabet har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |

S.05.01 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche*Generelle bemærkninger*

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema skal indberettes ud fra en regnskabsmæssig tilgang, dvs. lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP, men under anvendelse af Solvens II-brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Selskaber skal anvende samme værdiansættelses- og indregningsgrundlag som for de offentliggjorte regnskaber; der kræves ingen ny indregning eller ny værdiansættelse, medmindre andet er anført i disse vejledninger. Skemaet er baseret på et år-til-dato-grundlag, med undtagelse af klassificeringen mellem investeringsaftaler og forsikringsaftaler eller forskellige indberetningskrav, når dette anvendes i regnskabet. I dette skema indgår al forsikringsvirksomhed, uanset om der anvendes en eventuel forskellig klassificering af investeringsaftaler og forsikringsaftaler i regnskabet.

Forsikrings- og genforsikringsselskaber indberetter tegnede præmier/præmieindtægter som defineret i artikel 1, nr. 11) og 12), i delegeret forordning (EU) 2015/35, uanset om der er anvendt lokal GAAP eller IFRS.

Med hensyn til kvartalsvis indberetning skal administrationsomkostninger, udgifter til forvaltning af investeringer, anskaffelsesomkostninger, skadesbehandlingsomkostninger og overheadomkostninger angives aggregeret.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| <i>Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser</i> | | |
| C0010-C0120/ R0110 | Tegnede præmier — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0120/ R0120 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0130-C0160/ R0130 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0140 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikringsselskaber, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0200 | Tegnede præmier — Netto | De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. |
| C0010-C0120/ R0210 | Præmieindtægter — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0120/ R0220 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopremiehensættelser for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |
| C0130-C0160/ R0230 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopremiehensættelser for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |
| C0010-C0160/ R0240 | Præmieindtægter — Genfor- sikringsandel | Summen af genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen af præmiehensættelser. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |
| C0010-C0160/ R0300 | Præmieindtægter — Netto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopremiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0010-C0120/ R0310 | Erstatningsudgifter — Brutto — Direkte forsikringsvirksom- hed | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010-C0120/ R0320 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til bruttogenforsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0130-C0160/ R0330 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010-C0160/ R0340 | Erstatningsudgifter — Genfor- sikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: genforsikringsandelen af summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard). Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0160/ R0400 | Erstatningsudgifter — Netto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010-C0160/ R0550 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som selskabet har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |
| C0010-C0120/ R0610 | Administrationsomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer. Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto. |
| C0010-C0120/ R0620 | Administrationsomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer. Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto. |
| C0130-C0160/ R0630 | Administrationsomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer. Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0160/ R0640 | Administrationsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0700 | Administrationsomkostninger — Netto | <p>Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> |
| C0010-C0120/ R0710 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelser.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0120/ R0720 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelser.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0130-C0160/ R0730 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelser.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0160/ R0740 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Genforsikringsandel | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelser.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0800 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Netto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelser.</p> <p>Beløbet vedrører nettoudgifterne til forvaltning af investeringer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne ved investering summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> |
| C0010-C0120/ R0810 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0120/ R0820 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0130-C0160/ R0830 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0840 | Skadesbehandlingsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0900 | Skadesbehandlingsomkostninger — Netto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Nettoskadesbehandlingsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010-C0120/ R0910 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0120/ R0920 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0130-C0160/ R0930 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0160/ R0940 | Anskaffelsesomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R1000 | Anskaffelsesomkostninger — Netto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Nettoanskaffelsesomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0120/ R1010 | Overheadomkostninger — Direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto. |
| C0010-C0120/ R1020 | Overheadomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto. |
| C0130-C0160/ R1030 | Overheadomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto. |
| C0010-C0160/ R1040 | Overheadomkostninger — Genforsikringsandel | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører genforsikringsandelen. Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger. |
| C0010-C0160/ R1100 | Overheadomkostninger — Netto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | | Nettogeneralomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. |
| C0200/R0110–R1100 | I alt | I alt for forskellige poster for alle brancher. |
| C0200/R1210 | Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter, der ikke er omfattet af ovennævnte omkostninger/indtægter, og som er reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. Andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter opdeles ikke efter branche. Heri bør ikke medregnes ændring i andre forsikringsmæssige hensættelser og ikkeforsikringsmæssige omkostninger/indtægter, som f.eks. skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter skal indberettes som en negativ værdi, hvis de forsikringsmæssige indtægter overstiger de forsikringsmæssige omkostninger. |
| C0200/R1300 | Samlede forsikringsmæssige omkostninger | Forsikringsmæssige omkostninger i alt. |

Livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser

| | | |
|-------------------|---------------------------------------|---|
| C0210-C0280/R1410 | Tegnede præmier — Brutto | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. Heri medregnes både direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomhed. |
| C0210-C0280/R1420 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikringsselskaber og forfaldet, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0210-C0280/R1500 | Tegnede præmier — Netto | De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. |
| C0210-C0280/R1510 | Præmieindtægter — Brutto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |
| C0210-C0280/R1520 | Præmieindtægter — Genforsikringsandel | Genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen i præmiehensættelser. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0210-C0280/ R1600 | Præmieindtægter — Netto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0210-C0280/ R1610 | Erstatningsudgifter — Brutto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1620 | Erstatningsudgifter — Genforsikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som omhandlet i direktiv 91/674/EØF: Genforsikringsandelen i summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1700 | Erstatningsudgifter — Netto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som omhandlet i direktiv 91/674/EØF: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1900 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som selskabet har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |
| C0210-C0280/ R1910 | Administrationsomkostninger — Brutto | Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer. Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0210-C0280/ R1920 | Administrationsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f. eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2000 | Administrationsomkostninger — Netto | <p>Administrationsomkostninger, som selskabet pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f. eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører nettoadministrationsomkostningerne.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2010 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0210-C0280/ R2020 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Genforsikringsandel | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2100 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Netto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører nettoudgifterne til forvaltning af investeringer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne ved investering summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2110 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2120 | Skadesbehandlingsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0210-C0280/ R2200 | Skadesbehandlingsomkostninger — Netto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Nettoskadesbehandlingsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2210 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |
| C0210-C0280/ R2220 | Anskaffelsesomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2300 | Anskaffelsesomkostninger — Netto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Nettoanskaffelsesomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2310 | Overheadomkostninger — Brutto | <p>Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0210-C0280/ R2320 | Overheadomkostninger — Genforsikringsandel | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører genforsikringsandelen. Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger. |
| C0210-C0280/ R2400 | Overheadomkostninger — Netto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Nettogeneralomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. |
| C0300/R1410– R2400 | I alt | I alt for forskellige poster for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0300/R2510 | Balance — andre forsikrings- mæssige omkostninger/indtægter | Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter, der ikke er omfattet af ovennævnte omkostninger/indtægter, og som er reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. Andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter opdeles ikke efter branche. Heri bør ikke medregnes ændring i andre forsikringsmæssige hensættelser og ikkeforsikringsmæssige omkostninger/indtægter, som f.eks. skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter skal indberettes som en negativ værdi, hvis de forsikringsmæssige indtægter overstiger de forsikringsmæssige omkostninger. |
| C0300/R2600 | Samlede omkostninger | Forsikringsmæssige omkostninger i alt. |
| C0210-C0280/ R2700 | Genkøb i alt | Den samlede værdi af genkøb, der er sket i løbet af året. Beløbet indberettes også under erstatningsudgifter (post R1610). |

5.06.02 — Liste over aktiver

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Dette skema skal afspejle listen over alle aktiver i balancen, der kan klassificeres i aktivkategori 0-9 i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning. Især i tilfælde af aftaler om værdipapirudlån og -genkøb skal de underliggende værdipapirer, der beholdes i balancen, indberettes i dette skema.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over aktiver, der besiddes direkte af selskabet (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), og som kan klassificeres som aktivkategori 0-9 (i tilfælde af unit-linked og indeksregulerede produkter, der forvaltes af (gen)forsikrings-selskabet, er de aktiver, der skal indberettes, også kun dem, som er omfattet af aktivkategori 0-9; f.eks. skal beløb, der kan tilbagekræves, og forpligtelser forbundet med disse produkter ikke indberettes), med følgende undtagelser:

- a) Kontanter skal indberettes i én række pr. valuta, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.
- b) Konverterbare indskud (likvider) og andre indskud med en løbetid på under et år skal indberettes i én række pr. bank og valuta, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290.
- c) Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, herunder policelån, skal indberettes i to rækker, én række vedrørende lån til administrations-, ledelses- og tilsynsorganer, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290 og en anden række vedrørende lån til andre fysiske personer, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290.
- d) Indskud til cedenter skal indberettes i én række for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.
- e) Materielle anlægsaktiver til selskabets eget brug skal indberettes i én række for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.

Alle poster indberettes, medmindre andet er anført i denne vejledning. Posterne C0110, C0120, C0121, C0122, C0130, C0140, C0200, C0230, C0270, C0280, C0310, C0370 og C0380 gælder ikke for CIC 09 — Øvrige investeringer.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om aktiver.

I tabellen »Oplysninger om positioner, der besiddes« skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede ikkemonetære variabler, undtagen posten »Mængde«, i tabellen. Hvis der for det samme aktiv kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende aktiv indberettes i mere end én række.

I tabellen »Oplysninger om aktiver« skal hvert aktiv indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Oplysningerne om »Ekstern vurdering« (C0320) og »Udpeget ECAI« (C0330) kan begrænses (de indberettes ikke) i følgende tilfælde:

- a) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 35, stk. 6 og 7, i direktiv 2009/138/EF, eller
- b) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i tilfælde, hvor forsikrings- og genforsikrings-selskaberne har indført outsourcingaftaler vedrørende investeringer, hvilket medfører, at disse specifikke oplysninger ikke er direkte tilgængelige for selskabet.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Oplysninger om positioner, der besiddes

| | | |
|-------|---------------|---|
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstav-koden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
|-------|---------------|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|--|
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0060 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, andre interne fonde, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde.</p> <p>Underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed). En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Livsforsikring 2 — Skadesforsikring 3 — Ring-fenced fonde 4 — Andre interne fonde 5 — Aktiekapital 6 — Overordnet <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0070 | Fondsnummer | <p>Gælder for aktiver i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret på nationalt plan, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.08.01 og S.14.01). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> <p>Fondsnummeret er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed.</p> |
| C0080 | Matchtilpasningsportefølje-nummer | <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver matchtilpasningsportefølje som fastsat i artikel 77b, stk. 1, litra a), i direktiv 2009/138/EF. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere matchtilpasningsporteføljen i andre skemaer. Det må ikke genanvendes til en anden matchtilpasningsportefølje.</p> |
| C0090 | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | <p>Angiv de aktiver, der besiddes i unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Unit-linked eller indeksreguleret 2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret |
| C0100 | Aktiv stillet som sikkerhed | <p>Angiv aktiver i selskabets balance, der er stillet som sikkerhed. For aktiver, der kun delvis er stillet som sikkerhed, skal der indberettes to rækker for hvert aktiv; en for den værdi, der er stillet som sikkerhed, og en anden for den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes for aktivet:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Aktiver i balancen, der er stillet som sikkerhed 2 — Sikkerhedsstillelse for accepteret genforsikring 3 — Sikkerhedsstillelse for lånte værdipapirer 4 — Repoer 9 — Ikke sikkerhedsstillelse |
| C0110 | Deponeringsland | <p>»ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor selskabet har deponerede aktiver. Med henblik på identificering af internationale depositarer, som f.eks. Euroclear, er deponeringslandet det land, hvor der er indgået aftale om deponering.</p> <p>Hvis det samme aktiv er deponeret i mere end ét land, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle deponeringslande.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75 og for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver.</p> <p>Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer depotlandet til udstederlandet og fastsættes ud fra ejendommens adresse.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------------|---|
| C0120 | Depotinstitution | <p>Navnet på det finansieringsinstitut, der er depositar.</p> <p>Hvis det samme aktiv er deponeret hos mere end én depositar, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle depositarer.</p> <p>For aktiver, der opbevares koncerninternt, indberettes forsikringsselskabet som depositar.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75, CIC 09 og for CIC-kategori 9 — Ejendom og for ethvert andet aktiv, som i kraft af sin art ikke er deponeret</p> <p>For aktiver, hvor der ikke er en depositar, eller når denne post ikke finder anvendelse, angives »Ingen depositar«.</p> |
| C0121 | Depositarkode | <p>Angiv koden for depositaren ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0122 | Depositarens kodetype | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Depositarkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> |
| C0130 | Mængde | <p>Antal aktiver for relevante aktiver.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Pariværdi« (C0140) indberettes.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0140 | Pariværdi | <p>Udestående beløb målt til pariværdi, for alle aktiver, hvor denne post er relevant, og til nominal værdi for CIC 72, 73, 74, 75, 79 og CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån. Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. Denne post indberettes ikke, hvis posten »Mængde« (C0130) indberettes.</p> |
| C0145 | Langsigtet aktieinvestering | <p>Gælder kun CIC-kategori 3 — Kapitalandele og 4 — Kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>Angiv, om en aktie eller et kollektivt investeringsinstitut er klassificeret i henhold til bestemmelserne i artikel 171a i delegeret forordning (EU) 2015/35. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — Nej</p> <p>9 — Ikke relevant</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| C0150 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte aktiver. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver</p> <p>2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver</p> <p>3 — Alternative værdiansættelsesmetoder</p> <p>4 — Justeret indre værdis metode (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>5 — Indre værdis metode i henhold til IFRS (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> |
| C0160 | Anskaffelsesværdi | Samlet anskaffelsesværdi for de aktiver, der besiddes, ren værdi uden påløbne renter. Gælder ikke for CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud og 8 — Lån, herunder realkreditlån. |
| C0170 | Samlet Solvens II-værdi | <p>Værdi beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, svarende til:</p> <ul style="list-style-type: none"> — »Pariværdi« (udestående hovedstol målt til pariværdi eller nominel værdi) ganget med »Procentsats af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« plus »Påløbne renter«, for aktiver, hvor de første to poster er relevante — mængde« ganget med »Solvens II-pris pr. enhed«, for aktiver, hvor disse to poster er relevante (plus »Påløbne renter«, hvis det er relevant) — Solvens II-værdien af aktivet for aktiver, der kan klassificeres under aktivkategori CIC 71 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |
| C0180 | Påløbne renter | Angiv værdien af påløbne renter efter den sidste kupondato for rentebærende aktiver. Bemærk, at denne værdi også er en del af posten »Samlet Solvens II-værdi«. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Oplysninger om aktiver

| | | |
|-------|---------------|--|
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
|-------|---------------|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------|---|
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0190 | Betegnelse for posten | <p>Angiv den indberettede post ved at videregive de af selskabet fastsatte oplysninger om navnet på aktivet (eller adresse, hvis det drejer sig om ejendom).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC 87 og CIC 88 skal denne post indeholde »Lån til AMSB-medlemmer«, dvs. lån til administrations-, ledelses- og tilsynsorganet (»AMSB«) eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. Lån til andre end fysiske personer indberettes række for række. — Denne post er ikke relevant for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, eller for CIC 71 og CIC 75 (undtagen hvis påkrævet af den nationale tilsynsmyndighed). — For ejendomme indberettes ISO-landekoden alpha-2 + postnummer + by + gadenavn + husnummer) for den ejendom, der besiddes, eller den bredde- og længdegrad eller den CRESTA-/NUTS-region, for hvilken ejendomsinvesteringen indberettes: administrative grænser (f.eks. provins- eller distriktsgrænse f.eks. NUTS3-niveau) eller sammenlagte postkodeområder (f. eks. er de første to tal postkodeområder, i lighed med de såkaldte »low resolution zones« i CRESTA (Catastrophe Risk Evaluation and Standardising TARGET Accumulations) 2019[2]). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| C0200 | Udsteders navn | <p>Navnet på udstederen, defineret som den enhed, der udsteder aktiver til investorerne.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederens navn navnet på fondsforvalteren (enheden). Det autoriserede administrations-selskab, som kan have, og som har ansvaret for forvaltningen af fonde, er det, der skal indberettes, uanset om nogle af aktiviteterne er blevet outsourcet, herunder den faktiske forvaltning af porteføljen, dvs. købs-/salgsbeslutningen. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederens navn navnet på depositaren. — Hvad angår CIC 87 og CIC 88 skal denne post indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |
| C0210 | Udstederkode | <p>Angiv identifikationskoden for udstederen ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederkoden koden for fondsforvalteren (enheden). Det autoriserede administrations-selskab, som kan have, og som har ansvaret for forvaltningen af fonde, er det, der skal indberettes, uanset om nogle af aktiviteterne er blevet outsourcet, herunder den faktiske forvaltning af porteføljen, dvs. købs-/salgsbeslutningen. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederkoden koden for depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88. |
| C0220 | udstederkodetype | <p>Angiv, hvilken type udstederkode der anvendes under »Udstederkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|----------------|---|
| C0230 | Udstedersektor | <p>Angiv udstederens økonomiske sektor på grundlag den seneste udgave af NACE-koderne (den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter i EU) (som offentliggjort i en EF-forordning). For NACE-hovedafdelinger A til N kræves der ved fuld indberetning firecifrede NACE-koder, dvs. bogstavet for hovedafdelingen, efterfulgt af den firecifrede kode for kategorien (f.eks. »K6411«). For de resterende hovedafdelinger anvendes bogstavreferencen i NACE-koden, hvorved hovedafdelingen identificeres, som et minimum til identifikation af sektorer (f.eks. ville »P« eller »P8501« kunne godtages).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstedersektoren den sektor, som fondsforvalteren tilhører. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstedersektoren den sektor, som depositaren tilhører. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88. |
| C0240 | Udstedergruppe | <p>Navnet på udstederens øverste moderselskab. For kollektive investeringsinstitutter indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden).</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden). — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, vedrører koncerntilhørsforholdet låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for obligationer udstedt af: <ul style="list-style-type: none"> — en centralregering — et lokalt forvaltningsniveau — et offentligt organ — en centralbank — koncernen/enheden selv — en overstatslig organisation (såfremt der ikke findes en udstederkoncern) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| C0250 | Udstedergruppekode | <p>Angiv udstedergruppens identifikation ved hjælp af LEI, hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden). — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, vedrører koncerntilhørsforholdet låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for obligationer udstedt af: <ul style="list-style-type: none"> — en centralregering — et lokalt forvaltningsniveau — et offentligt organ — en centralbank — koncernen/enheden selv — en overstatslig organisation (såfremt der ikke findes en udstederkoncern) |
| C0260 | Type udstedergruppekode | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Udstedergruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 9 — Ingen |
| C0270 | Udstederland | <p>ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor udstederen befinder sig. Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederlandet fondsforvalterens (enhedens) land. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstederlandet depositarens land. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode — XA: Overstatslige udstedere (offentlige institutioner, der er oprettet ved en aftale mellem nationalstater, f.eks. i form af værdipapirer udstedt af en multilateral udviklingsbank som omhandlet i artikel 117, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller værdipapirer udstedt af en international organisation som omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, med undtagelse af Den Europæiske Unions institutioner) — EU: Den Europæiske Unions institutioner (jf. artikel 13 i Traktaten om Den Europæiske Union). |
| C0280 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88, da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, for CIC 75, CIC 09 og CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug) af samme grund. — Hvad angår CIC-kategori 9 — Ejendom, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer valuta til den valuta, som investeringen blev foretaget i. |
| C0290 | CIC | <p>Den CIC-kode, der anvendes til at klassificere aktiver som fastsat i bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når et aktiv klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som aktivet er eksponeret for.</p> |
| C0292 | Tilgang ved beregningen af solvenskapitalkrav for et kollektivt investeringsinstitut (CIU) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — CIU'er, for hvilke der er anvendt en se-igennem-metode ved beregningen af solvenskapitalkrav i overensstemmelse med artikel 84, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2015/35 2 — CIU'er, for hvilke der er anvendt en »forenklet« se-igennem-metode på grundlag af den tilstræbte allokering af det underliggende aktiv eller senest indberettede allokering af aktiver, og for hvilke datagrupperingerne anvendes, jf. artikel 84, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35 3 — CIU'er, for hvilke der er anvendt en »forenklet« se-igennem-metode på grundlag af den tilstræbte allokering af det underliggende aktiv eller senest indberettede allokering af aktiver, og for hvilke der ikke anvendes datagrupperinger, jf. artikel 84, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35 4 — CIU'er, for hvilke »aktierisici — type 2« blev anvendt, jf. artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. 9 — Ikke relevant. <p>Valgmulighederne under denne post i forbindelse med se-igennem-metoden skal afspejle den metode, der anvendes til beregningen af solvenskapitalkravet. Med henblik på indberetning af oplysninger efter se-igennem-metoden, jf. skema S.06.03, kræves oplysningerne efter se-igennem-metoden under hensyntagen til de tærskler, der er defineret i dette skemas generelle bemærkninger.</p> <p>Denne post er kun relevant for CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0293 | Bestemmelser om bail-in | <p>Angiv, om aktivet er underlagt bestemmelser om bail-in i overensstemmelse med artikel 43 og 44 i direktiv 2014/59/EU (direktivet om genopretning og afvikling af banker — BRRD)</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — nej</p> <p>9 — ikke relevant.</p> |
| C0294 | Regionale regeringer og lokale myndigheder | <p>Angiv, om aktiver udstedt eller garanteret af regionale regeringer og lokale myndigheder, uanset om de er opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, vedrørende aktiver, der kan klassificeres under CIC 13 og 14.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011</p> <p>2 — Ikke opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011</p> <p>9 — ikke relevant.</p> |
| C0295 | Kryptoaktiver | <p>Angiv aktiver, der er knyttet til kryptoaktiver.</p> <p>»Kryptoaktiv«: en digital gengivelse af værdi eller rettigheder, som kan overføres og lagres elektronisk ved hjælp af distributed ledger-teknologi eller lignende teknologi</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — »Elektronisk pengetoken«: en form for kryptoaktiv, hvis hovedformål er anvendelse som et omsætningsmiddel, og som hævdes at bevare en stabil værdi ved at henvise til værdien af en fiatvaluta, der er lovligt betalingsmiddel</p> <p>2 — »Aktivbaseret token«: en form for kryptoaktiv, som hævdes at bevare en stabil værdi, ved at henvise til værdien af flere fiatvalutaer, der er lovligt betalingsmidler, en eller flere råvarer eller et eller flere kryptoaktiver, eller en kombination af sådanne aktiver</p> <p>3 — »Utility token«: en form for kryptoaktiv, som er beregnet til at give digital adgang til en vare eller en tjenesteydelse, der er tilgængelig i forbindelse med DLT, og som kun kan accepteres af udsteder af denne token</p> <p>4 — Øvrige kryptoaktiver</p> <p>5 — Nej</p> |
| C0296 | Ejendomstype | <p>Angiv ejendomstype i henhold til ESRB's henstilling af 21. marts 2019 om ændring af henstilling ESRB/2016/14 om lukning af datahuller vedrørende fast ejendom.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — beboelse, f.eks. boliger med flere husholdninger</p> <p>2 — detailhandel, f.eks. hoteller, restauranter, indkøbscentre</p> <p>3 — kontorer, f.eks. en ejendom, der primært bruges som erhvervs- eller forretningsmæssige kontorer</p> <p>4 — industri, f.eks. en ejendom, der bruges til produktion, distribution og logistik</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|---|
| | | <p>5 — andre typer erhvervsejendomme</p> <p>9 — ikke relevant.</p> <p>Såfremt en fast ejendom bruges til flere formål, betragtes den som forskellige ejendomme (f.eks. baseret på det overfladeareal, der vedrører de respektive brugstyper), hvis en sådan specifikation er mulig, ellers kan ejendommen klassificeres efter den dominerende brug</p> <p>Denne post er kun relevant for CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0297 | Ejendommens beliggenhed | <p>Angiv ejendomsbeliggenhed i henhold til ESRB's henstilling af 21. marts 2019 om ændring af henstilling ESRB/2016/14 om lukning af datahuller vedrørende fast ejendom.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Bedste beliggenhed</p> <p>2 — Anden beliggenhed</p> <p>9 — ikke relevant.</p> <p>Denne post er kun relevant for CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0300 | Infrastrukturinvestering | <p>Angiv, om aktivet er en infrastrukturinvestering som defineret i artikel 1, nr. 55a) og 55b), i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ikke en infrastrukturinvestering</p> <p>2 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: offentlig garanti (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>3 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: initiativ med offentlig støtte, herunder offentlig-private partnerskaber (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>4 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: initiativ med overstatslig garanti/støtte (ECB, multilateral udviklingsbank, international organisation)</p> <p>9 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: andre ikke-kvalificerede infrastrukturlån eller -investeringer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier</p> <p>12 — Infrastruktur, kvalificeret: offentlig garanti (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>13 — Infrastruktur, kvalificeret: initiativ med offentlig støtte, herunder offentlig-private partnerskaber (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>14 — Infrastruktur, kvalificeret: initiativ med overstatslig garanti/støtte (ECB, multilateral udviklingsbank, international organisation)</p> <p>19 — Infrastruktur, kvalificeret: andre kvalificerede infrastrukturinvesteringer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier</p> <p>20 — europæisk langsigtet investeringsfond (ELTIF, der investerer i infrastrukturaktiver, og ELTIF, der investerer i andre aktiver — ikke infrastruktur — aktiver)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0310 | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser | <p>Gælder kun for CIC-kategori 3 — Kapitalandele og 4 — Kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>Angiv, om en aktie eller anden andel er en kapitalinteresse. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ikke en kapitalinteresse</p> <p>2 — Det er en kapitalinteresse, hvorpå der anvendes en se-igennem-metode i henhold til artikel 84 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>3 — Det er en kapitalinteresse, hvorpå der ikke anvendes en se-igennem-metode i henhold til artikel 84 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0320 | Ekstern rating | <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer og 6 — Sikrede værdipapirer, CIC 87 og CIC 88, hvor det måtte være relevant.</p> <p>Udstedelsesvurderingen af aktivet pr. referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Hvis der ikke foreligger en udstedelsesvurdering, udfyldes denne post ikke.</p> |
| C0330 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0320, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger udstedt af ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med forordning (EF) nr. 1060/2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån (undtagen CIC 87 og CIC 88), hvor det måtte være relevant.</p> <p>Denne post indberettes, når »Ekstern vurdering« (C0320) indberettes. Hvis »Der er ikke udpeget et ECAI, og der anvendes en forenkling til at beregne SCR«, udfyldes Ekstern vurdering (C0320) ikke, og i Kreditkvalitetstrin (C0340) anvendes en af følgende valgmuligheder: 2a, 3a eller 3b.</p> |
| C0340 | Kreditkvalitetstrin | <p>Relevant for alle aktiver, til hvilke der skal henføres kreditkvalitetstrin med henblik på beregningen af solvenskapitalkravet.</p> <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt aktivet, jf. artikel 109a, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF ved anvendelse af den konverteringstabel, der anføres i gennemførelsesforordning (EU) 2016/1800.</p> <p>Kreditkvalitetstrinnet skal især afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> <p>Denne post er ikke relevant for aktiver, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>2a — Kreditkvalitetstrin 2 som følge af anvendelsen af artikel 176a i delegeret forordning (EU) 2015/35 i forbindelse med ikke-vurderede obligationer og lån</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>3a — Kreditkvalitetstrin 3 som følge af anvendelsen af den forenklede beregning i henhold til artikel 105a i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>3b — Kreditkvalitetstrin 3 som følge af anvendelsen af artikel 176a i delegeret forordning (EU) 2015/35 i forbindelse med ikke-vurderede obligationer og lån</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering</p> |
| C0350 | Intern vurdering | <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån (undtagen CIC 87 og CIC 88), hvor det måtte være relevant.</p> <p>Intern vurdering af aktiver for selskaber, der bruger interne vurderinger</p> <p>For selskaber, der anvender matchtilpasning, indberettes posten, i det omfang de interne vurderinger anvendes til beregning af det grundlæggende spread, jf. artikel 77c, stk. 2., i direktiv 2009/138/EF.</p> |
| C0360 | Varighed | <p>Gælder kun for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 4 — Kollektive investeringsinstitutter (hvis det er relevant, f.eks. for kollektive investeringsinstitutter, der hovedsageligt investerer i obligationer), 5 — Strukturerede værdipapirer og 6 — Sikrede værdipapirer.</p> <p>Aktivets varighed, defineret som »resterende modificeret varighed« (modificeret varighed, der er beregnet på grundlag af værdipapirets restløbetid, regnet fra referencedatoen for indberetningen). For aktiver uden faste løbetider anvendes den første indløsningsdato, men sandsynligheden, for at call-optionen gøres gældende, skal tages i betragtning. Varigheden skal beregnes på grundlag af den økonomiske værdi.</p> |
| C0370 | Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i indberetningsvalutaen, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »mængde« (C0130) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«).</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« (C0380) indberettes.</p> |
| C0380 | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i procent af pariværdi, »clean price« uden påløbne renter, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »pariværdi« (C0140) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«), undtagen for CIC 71 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Solvens II-pris pr. enhed« (C0370) indberettes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------|---|
| C0390 | Udløbsdato | <p>Gælder kun for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 74 og CIC 79.</p> <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for forfaldsdatoen.</p> <p>Svarer altid til forfaldsdatoen, selv for værdipapirer, som kan kræves indkaldt.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For værdipapirer uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«. — For CIC 87 og CIC 88 indberettes den vægtede (på basis af lånebeløbet) restløbetid. |

S.06.03 — Kollektive investeringsinstitutter — se-igennem-metode

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema indeholder oplysninger anført efter se igennem-metoden for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde, herunder også når det drejer sig om kapitalinteresser, efter det underliggende aktivs kategori, udstedelsesland og valuta. Under hensyn til proportionaliteten og den specifikke vejledning til skemaet anvendes se-igennem-metoden, indtil kategorierne, landene og valutaerne er identificeret. Hvad angår fonde, der investerer i andre fonde, skal se-igennem-metoden anvendes efter samme princip.

Skemaet skal indeholde oplysninger svarende til 100 % af den værdi, der er investeret i kollektive investeringsinstitutter. Med henblik på at identificere lande skal se-igennem-metoden dog anvendes for at identificere eksponeringer for 90 % af den samlede værdi af fondene minus de beløb, der vedrører CIC 8 og 9, og med henblik på at identificere valutaer skal se-igennem-metoden anvendes for at identificere eksponeringer for 90 % af den samlede værdi af fondene. Selskaber skal sikre, at de 10 %, der ikke er identificeret efter land, er diversificeret over geografiske områder, dvs. eksempelvis at højst 5 % befinder sig i ét og samme land. Se-igennem-metoden skal anvendes af selskaber, idet man begynder med den største, under hensyn til det investerede beløb, til den mindste enkelte fond, og metoden skal forblive konsistent over tid.

Oplysninger, der indberettes hvert kvartal, skal kun indberettes, når den andel af kollektive investeringsinstitutter, som besiddes af selskabet, af de samlede investeringer, målt som forholdet mellem post C0010/R0180 i skema S.02.01 plus kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0220 i skema S.02.01 plus kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0090 og summen af post C0010/R0070 og C0010/RC0220 i skema S.02.01 overstiger 30 %.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0010 | UCI-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0020 | ID-kodetype for kollektivt investeringselskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|----------------------------------|--|
| | | <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> |
| C0030 | Kategori for underliggende aktiv | <p>Angiv aktivkategorier, tilgodehavender og derivater i instituttet for kollektiv investering. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Statsobligationer</p> <p>2 — Erhvervsobligationer</p> <p>3L — Noterede aktier</p> <p>3X — Unoterede aktier</p> <p>4 — Kollektive investeringsinstitutter</p> <p>5 — Strukturerede værdipapirer</p> <p>6 — Sikrede værdipapirer</p> <p>7 — Kontanter og indskud</p> <p>8 — Lån, herunder realkreditlån</p> <p>9 — Ejendomme</p> <p>0 — Øvrige investeringer (herunder tilgodehavender)</p> <p>A — Futures</p> <p>B — Call-optioner</p> <p>C — Put-optioner</p> <p>D — Swaps</p> <p>E — Forwards</p> <p>F — Kreditderivater</p> <p>L — Forpligtelser</p> <p>Kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter« anvendes kun for uvæsentlige restværdier for både fonde, der investerer i andre fonde, og alle andre typer fonde.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------|--|
| C0040 | Udstedelsesland | <p>Specifikation af hver aktivkategori angivet under post C0030 efter udstederland. Angiv det land, hvor udstederen befinder sig.</p> <p>Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode — XA: Supranationale udstedere — EU: Den Europæiske Unions institutioner — AA: aggregerede lande, da der anvendes en tærskel <p>Denne post er ikke relevant for kategori 7, 8 og 9, da den indberettes under C0030.</p> |
| C0050 | Valuta | <p>Angiv, om aktivkategoriens valuta er indberetningsvalutaen eller en fremmed valuta. Alle andre valutaer end indberetningsvalutaen anses for at være fremmede valutaer. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Indberetningsvaluta 2 — Fremmed valuta 3 — Aggregerede valutaer, da der anvendes en tærskel |
| C0060 | Samlet beløb | <p>Det samlede investerede beløb efter aktivkategori, land og valuta gennem kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>For forpligtelser skal der indberettes en positiv værdi, medmindre posten er en derivatforpligtelse.</p> <p>For derivater kan den samlede værdi være positiv (hvis der er tale om et aktiv) eller negativ (hvis der er tale om en forpligtelse).</p> |

S.06.04 — Risici som følge af klimaændringer i relation til investeringer

Generelle bemærkninger:

Dette skema indberettes ved regelmæssig indberetning, også hvis der ikke findes en KPI. Hvis der ikke indberettes en KPI, skal der anføres en begrundelse i R0040/C0010 og/eller R0050/C0010.

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indeholder oplysninger om den del af investeringerne, der er eksponeret for overgangsrisiko og fysisk risiko som følge af klimaændringer. Som input til beregningen af den investeringsandel, der er eksponeret for overgangsrisiko, skal selskaber indberette de fire-cifrede Nace-koder til Nace-hovedafdelingerne A til N i listen over aktiver S.06.02. Hvad angår fysiske risici skal selskaberne på standardiseret vis indberette ejendommens beliggenhed på listen over aktiver S.06.02,

| | | |
|-------------|---|--|
| R0010/C0010 | Overgangsrisici som følge af klimaændringer — KPI | <p>Andel af Solvens II-værdien af de investeringer, der er eksponeret for overgangsrisiko, i forhold til de samlede investeringer. Selskaberne kan anvende deres egen metode til beregning af KPI. Angivelsen af de investeringer, der er eksponeret for overgangsrisiko, skal være i overensstemmelse med den klassifikation, der er foretaget og indberettet med de fire-cifrede Nace-koder til Nace-hovedafdelingerne A til N, jf. S.06.02.</p> |
|-------------|---|--|

| | | |
|-------------|--|--|
| R0020/C0010 | Fysiske risici som følge af klimaændringer — KPI | Andel af Solvens II-værdien af de ejendomme, der er eksponeret for fysisk risiko, i forhold til de samlede ejendomme. Selskaberne kan anvende deres egen metode til beregning af KPI. Angivelsen af de ejendomme, der er eksponeret for fysiske risici, skal være i overensstemmelse med den angivelse, der er foretaget i C0190 Betegnelse for posten i S.06.02 |
| R0030/C0010 | Begrundelse for ikke at indberette overgangsrisici som følge af klimaændringer — KPI | Redegørelse for, hvorfor KPI for overgangsrisici som følge af klimaændringer ikke er blevet indberettet (dvs. ikke væsentlig) |
| R0040/C0010 | Begrundelse for ikke at indberette fysiske risici som følge af klimaændringer — KPI | Redegørelse for, hvorfor KPI for fysiske risici som følge af klimaændringer ikke er blevet indberettet (dvs. ikke væsentlig) |

S.07.01 — Strukturerede produkter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over strukturerede produkter, der besiddes direkte af selskabet i dets portefølje (dvs. ikke efter se-gennem-metoden). Strukturerede produkter defineres som aktiver, der hører ind under aktivkategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer).

Dette skema indberettes kun, hvis mængden af strukturerede produkter, målt som forholdet mellem aktiver klassificeret i aktivkategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer) som defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning og summen af post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01, overstiger 5 %.

I nogle tilfælde angiver typerne af strukturerede produkter (C0070), hvilket derivat der er indbygget i det strukturerede produkt. Hvis det strukturerede produkt har det pågældende derivat indbygget, anvendes denne klassificering.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|--|
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Identifikationskoden for det strukturerede produkt som indberettet i S.06.02 (i følgende prioriterede rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Den anvendte kode skal forblive konsistent over tid og må ikke genanvendes til andre produkter. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------|---|
| | | <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0060 | Sikkerhedsstillellestype | <p>Angiv sikkerhedsstillellestypen ved hjælp af de aktivkategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Statsobligationer</p> <p>2 — Erhvervsobligationer</p> <p>3 — Kapitalandele</p> <p>4 — Kollektive investeringsinstitutter</p> <p>5 — Strukturerede værdipapirer</p> <p>6 — Sikrede værdipapirer</p> <p>7 — Kontanter og indskud</p> <p>8 — Lån, herunder realkreditlån</p> <p>9 — Ejendomme</p> <p>0 — Øvrige investeringer</p> <p>10 — Ingen sikkerhedsstillelse</p> <p>Hvis der findes mere end én kategori af sikkerhedsstillelse for et enkelt struktureret produkt, indberettes den mest repræsentative.</p> |
| C0070 | Type struktureret produkt | <p>Angiv typen af struktur for produktet. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Credit linked notes</p> <p>Værdipapir eller indskud med et indbygget kreditderivat (f.eks. credit default swaps eller credit default-optioner)</p> <p>2 — Constant maturity swaps (CMS)</p> <p>(værdipapir med indbygget renteswap, hvor andelen med variabel rente periodisk tilpasses til en markedsrente for faste løbetider)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>3 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver (værdipapir, der har et aktiv som sikkerhedsstillelse)</p> <p>4 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom (værdipapir, der har fast ejendom som sikkerhedsstillelse)</p> <p>5 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsjendom (værdipapir, der har erhvervsjendom som sikkerhedsstillelse, f.eks. detailejendomme, industriejendomme, flerfamiliehuse og hoteller)</p> <p>6 — Strukturerede kreditobligationer (struktureret gældsbevis med sikkerhed i en portefølje bestående af sikrede eller usikrede obligationer (erhvervsobligationer eller statsobligationer) eller af sikrede eller usikrede lån til kommercielle og industrielle virksomheder, som er lånekunder i udlånsbanker)</p> <p>7 — Collateralised loan obligations (CLO-obligationer) (værdipapir, der som underliggende aktiv har en portefølje af lån, hvor cash flowet fra værdipapiret er afledt af porteføljen)</p> <p>8 — Collateralised mortgage obligations (CMO-obligationer) (investment grade-værdipapir understøttet af en pulje af obligationer, lån og andre aktiver)</p> <p>9 — Værdipapirer og indskud knyttet til rentesats</p> <p>10 — Aktiebaserede værdipapirer og indskud og aktieindeksbaserede værdipapirer og indskud</p> <p>11 — Værdipapirer og indskud knyttet til valuta og råvarer</p> <p>12 — Værdipapirer og indskud knyttet til hybridinstrumenter (heri indgår fast ejendom og aktier)</p> <p>13 — Værdipapirer og indskud knyttet til markedet</p> <p>14 — Værdipapirer og indskud knyttet til forsikring, herunder værdipapirer, der omfatter katastrofe- og vejrisici samt dødelighedsrisici</p> <p>99 — Andet ikke omfattet af foregående valgmuligheder</p> |
| C0080 | Kapitalbeskyttelse | <p>Angiv, om produktet er kapitalbeskyttet. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fuldstændig kapitalbeskyttelse</p> <p>2 — Delvis kapitalbeskyttelse</p> <p>3 — Ingen kapitalbeskyttelse</p> |
| C0090 | Underliggende værdipapir/indeks/portefølje | <p>Beskriv typen af underliggende aktiv. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Aktier og fonde (en udvalgt gruppe eller kurv af aktier)</p> <p>2 — Valuta (en udvalgt gruppe eller kurv af valutaer)</p> <p>3 — Rentesats og afkast (obligationsindeks, afkastkurver, forskelle i gældende rentesatser for kortere og længere løbetider, kreditspænd, inflationsrater og andre benchmarks i relation til rentesats eller afkast)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>4 — Råvarer (en udvalgt vare eller gruppe af varer)</p> <p>5 — Indeks (resultaterne af et udvalgt indeks)</p> <p>6 — Flere (giver mulighed for at kombinere ovenstående mulige typer)</p> <p>9 — Andet ikke omfattet af foregående valgmuligheder (f.eks. andre økonomiske indikatorer)</p> |
| C0100 | Callable eller putable | <p>Angiv, om produktet har call- og/eller put-karakteristika eller begge, hvis det er relevant. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Købers call-option</p> <p>2 — Sælgers call-option</p> <p>3 — Købers put-option</p> <p>4 — Sælgers put-option</p> <p>5 — Enhver kombination af ovenstående valgmuligheder</p> <p>6 — Ikke relevant</p> |
| C0110 | Syntetisk struktureret produkt | <p>Angiv, om det er et struktureret produkt uden overdragelse af aktiver (f.eks. produkter, der ikke giver anledning til levering af aktiver, bortset fra kontanter, hvis der indtræder en ugunstig/gunstig hændelse). En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Struktureret produkt uden overdragelse af aktiv</p> <p>2 — Struktureret produkt med overdragelse af aktiv</p> |
| C0120 | Struktureret produkt med førtidig indfrielse | <p>Angiv, om det er et struktureret produkt med mulighed for førtidig indfrielse, som betragtes som en tidlig ikkeplanlagt tilbagebetaling af hovedstolen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Struktureret produkt med førtidig indfrielse</p> <p>2 — Ikke et struktureret produkt med førtidig indfrielse</p> |
| C0130 | Værdi af sikkerhedsstillelse | <p>Den samlede sikkerhedsstillelse i forbindelse med det strukturerede produkt uanset arten af sikkerhedsstillelsen.</p> <p>I tilfælde af sikkerhedsstillelse på grundlag af en portefølje indberettes kun den værdi, der vedrører den enkelte kontrakt, og ikke den samlede værdi.</p> |
| C0140 | Sikkerhedsstillelse på porteføljebasis | <p>I denne post oplyses om, hvorvidt sikkerhedsstillelsen for det strukturerede produkt dækker ét struktureret produkt eller mere end ét struktureret produkt, der besiddes af selskabet. Nettopositioner vedrører positionerne for strukturerede produkter. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Sikkerhedsstillelse beregnet på grundlag af nettopositioner opgjort ud fra et sæt kontrakter</p> <p>2 — Sikkerhedsstillelse beregnet på grundlag af én enkelt kontrakt</p> <p>10 — Ingen sikkerhedsstillelse</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|--|
| C0150 | Fast årligt afkast | Angiv kuponen (indberettes som decimaltal), hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). |
| C0160 | Variabelt årligt afkast | Angiv det variable afkast, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Det angives normalt som en benchmark-markedsrente plus et spænd eller som afhængig af resultaterne af en portefølje eller et indeks (afhængig af underliggende) eller mere komplekse afkast, som bl.a. afhænger af stien for det underliggende aktivs pris (stiafhængig). Når det er nødvendigt, kan denne post indberettes som en streng for at afspejle, hvordan afkastet beregnes. |
| C0170 | Tab givet misligholdelse | Procenten (indberettet som decimaltal), af det investerede beløb, som ikke vil blive inddrevet efter misligholdelse, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Hvis de pågældende oplysninger ikke er defineret i kontrakten, skal denne post ikke indberettes. Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |
| C0180 | Attachment point | Den kontraktligt fastsatte tabsprocent (indberettet som decimaltal), over hvilken tabene påvirker det strukturerede produkt, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |
| C0190 | Detachment point | Den kontraktligt fastsatte tabsprocent (indberettet som decimaltal), over hvilken tabene ophører med at påvirke det strukturerede produkt, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |

5.08.01 — Åbne derivater

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

De i dette skema omhandlede derivatkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Skemaet indeholder en post-for-post-liste over derivater, der besiddes direkte af selskabet (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), og som kan klassificeres i aktivkategori A-F.

Dette skema omfatter derivater, der handles på en fondsbørs eller på et tilsvarende centraliseret marked, og derivater, der handles OTC.

Når et derivat handles på en fondsbørs eller på et tilsvarende centraliseret marked, er modparten fondsbørsen eller et tilsvarende centraliseret marked og ikke den ultimative modpart, som det er tilfældet for derivater, der handles OTC.

Derivater betragtes som aktiver, hvis deres Solvens II-værdi er positiv eller nul. De betragtes som forpligtelser, hvis deres Solvens II-værdi er negativ. Både derivater, der betragtes som aktiver, og derivater, der betragtes som forpligtelser, skal medtages.

Oplysningerne skal omfatte alle derivatkontrakter, der forelå i indberetningsperioden, og som ikke var afsluttet inden referencdatoen for indberetningen.

Hvis der er hyppige handler med det samme derivat, hvilket medfører mange åbne positioner, kan derivatet indberettes på aggregeret basis eller på nettobasis, når blot alle relevante egenskaber er fælles og følger den specifikke vejledning for hver enkelt relevant post.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

Et derivat er et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:

- Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikkefinansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).
- Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.
- Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om derivater.

I tabellen »Oplysninger om positioner« skal hvert derivat indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede ikkemonetære variabler i tabellen. Hvis der for det samme derivat kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende derivat indberettes i mere end én række.

Især for så vidt angår derivater, der har mere end ét valutapar, skal det opdeles i parkomponenterne og indberettes i forskellige rækker.

I tabellen »Oplysninger om derivater« skal hvert derivat indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Oplysningerne om »Ekstern vurdering« (C0290) og »Udpeget ECAI« (C0300) kan begrænses (de indberettes ikke) i følgende tilfælde:

- efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 35, stk. 6 og 7, i direktiv 2009/138/EF, eller
- efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i tilfælde, hvor forsikrings- og genforsikringselskaberne har indført outsourcingaftaler vedrørende investeringer, hvilket medfører, at disse specifikke oplysninger ikke er direkte tilgængelige for selskabet.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|--|
| <i>Oplysninger om positioner, der besiddes</i> | | |
| C0040 | Derivat-ID-kode | Derivat-ID-kode i følgende prioriterede rækkefølge: — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0041 | Entydig transaktionsidentifikator (Unique transaction identifier) | Angiv de handelsidentifikatorer, der er anvendt i handelsrapporterne til transaktionsregistre i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre. Under denne post indberettes så mange handelsidentifikatorer som nødvendigt for at kunne etablere den position, der indberettes. Handelsidentifikatorer indberettes adskilt ved komma. Denne post indberettes med »Intet ID«, når derivatet ikke falder ind under forordning (EU) nr. 648/2012. |
| C0050 | Derivat-ID-kodetype | ID-kodetype anvendt under »Derivat-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> |
| C0060 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde.</p> <p>Underliggende derivater for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende derivater for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Livsforsikring</p> <p>2 — Skadesforsikring</p> <p>3 — Ring-fenced fonde</p> <p>4 — Andre interne fonde</p> <p>5 — Aktiekapital</p> <p>6 — Overordnet</p> <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> |
| C0070 | Fondsnummer | <p>Gælder for derivater i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret på nationalt plan, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.06.02 og S.14.01). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> |
| C0080 | Derivater i unit-linked og indeksregulerede aftaler | <p>Angiv de derivater, der besiddes i forbindelse med unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Unit-linked eller indeksreguleret</p> <p>2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0090 | Underliggende instrument for derivatet | <p>ID-kode for det underliggende instrument (aktiv eller forpligtelse) for derivatkontrakten. Denne post skal kun indberettes for derivater, der har et enkelt eller mange underliggende instrumenter i selskabets portefølje. Et indeks betragtes som et enkelt instrument og skal indberettes. Identifikationskode for det underliggende instrument for derivatet i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, for det underliggende instrument, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være unik og konsistent over tid for dette instrument — »Mange aktiver/forpligtelser«, hvis der er mere end ét underliggende aktiv eller én underliggende forpligtelse. <p>Hvis det underliggende instrument er et indeks, så indberettes koden for indekset.»</p> |
| C0100 | Kodetype for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet. | <p>Type ID-kode anvendt under »Det underliggende instrument for derivatet«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (global identifikator for finansielle instrumenter) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet, hvis ingen af ovenstående muligheder er tilgængelige. Denne valgmulighed anvendes ligeledes i forbindelse med »Mange aktiver/forpligtelser« og indeks. |
| C0110 | Brug af derivat | <p>Beskriv brugen af derivatet (mikro-/makroafdækning, effektiv porteføljeforvaltning).</p> <p>Mikroafdækning vedrører derivater, der dækker ét enkelt finansielt instrument (aktiv eller forpligtelse), én enkelt forventet transaktion eller én enkelt anden forpligtelse.</p> <p>Makroafdækning vedrører derivater, der dækker et sæt finansielle instrumenter (aktiver eller forpligtelser), forventede transaktioner eller andre forpligtelser.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|---|
| | | <p>Effektiv forvaltning af porteføljen refererer normalt til aktiviteter, hvor forvalteren ønsker at forbedre porteføljens indtægter ved at erstatte et (lavere) cash flow-mønster med et andet med en højere værdi ved hjælp af et derivat eller sæt af derivater — uden at ændre aktivporteføljens sammensætning — med lavere investeringsbeløb og færre transaktionsomkostninger.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Mikroafdækning 2 — Makroafdækning 3 — Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser anvendt i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer 4 — Effektiv porteføljeforvaltning bortset fra »Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser« anvendt i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer |
| | | |
| C0131 | Notionelt beløb for derivatet | <p>Det beløb, der er dækket eller eksponeret i forbindelse med derivatet, indberettet i den oprindelige valuta.</p> <p>For futures og optioner svarer det til kontraktstørrelse ganget med den udløsende værdi og med antal aftaler, der er indberettet i denne række. For swaps og forwards svarer det til kontraktbeløbet for de kontrakter, der er indberettet i denne række. Hvis den udløsende værdi svarer til et interval, anvendes gennemsnitsværdien for intervallet.</p> <p>Den notionelle værdi henviser til det beløb, der sikres/investeres (når ingen risici dækkes). Hvis der forekommer flere handler, er der tale om nettobeløbet på indberetningsdatoen.</p> |
| C0140 | Køber/sælger | <p>Kun for aftaler om futures og optioner, swaps og kreditderivater</p> <p>Angiv, om derivatkontrakten blev købt eller solgt.</p> <p>Køber- eller sælgerpositionen for swaps defineres i forhold til værdipapiret eller det notionelle beløb og swap flow.</p> <p>En sælger af en swap ejer værdipapiret eller det notionelle beløb ved aftalens indgåelse og erklærer sig villig til, i løbet af kontraktens løbetid, at levere dette værdipapir eller notionelle beløb, herunder alle andre udgående strømme, som er forbundet med kontrakten, hvis det er relevant.</p> <p>En køber af en swap vil eje værdipapiret eller det notionelle beløb ved derivatkontraktens udløb og vil i løbet af kontraktens løbetid modtage dette værdipapir eller notionelle beløb, herunder alle andre indgående strømme, som er forbundet med kontrakten, hvis det er relevant.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes, dog ikke for renteswaps:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Køber 2 — Sælger <p>For renteswaps anvendes en af valgmulighederne i følgende udtømmende liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 3 — FX—FL: leveres fixed-for-floating 4 — FX—FX: leveres fixed-for-floating 5 — FX—FX: leveres floating-for-fixed 6 — FX—FX: leveres floating-for-floating |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0150 | Til dato betalt præmie | Betaling erlagt (hvis købt) for optioner og også forudbetalinger og periodiske præmiebeløb betalt for swaps siden det tidspunkt, hvor selskabet indgik derivatkontrakten. |
| C0160 | Til dato modtaget præmie | Betaling modtaget (hvis solgt) for optioner og også forudbetalinger og periodiske præmiebeløb modtaget for swaps siden det tidspunkt, hvor selskabet indgik derivatkontrakten. |
| C0170 | Antal kontrakter | Antal lignende derivatkontrakter indberettet i rækken. Det skal være det antal kontrakter, der er indgået. For over the counter-derivater indberettes f.eks. én swapkontrakt som »1«, og for ti swaps med samme karakteristika indberettes »10«. Antallet af aftaler kan være et ikkeheltal, hvis der er behov for at opdele aftaler. Antallet af kontrakter skal svare til dem, der var udestående på indberetningsdatoen. |
| C0180 | Kontraktstørrelse | Antal underliggende aktiver i kontrakten (for aktiefutures er det f.eks. antal aktier, der skal overdrages pr. derivatkontrakt ved udløb, for obligationsfutures er det det for hver kontrakt underliggende referencebeløb). Den måde, hvorpå kontraktstørrelsen fastsættes, varierer afhængigt af instrumenttype. For aktiefutures er det almindeligt, at kontraktstørrelsen fastsættes i forhold til antal underliggende aktier. For obligationsfutures er det den for kontrakten underliggende nominelle værdi. Kun relevant for futures og optioner. |
| C0190 | Maksimalt tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling | Maksimumsbeløbet for tab, hvis der indtræffer en hændelse, der fører til afvikling. Kun relevant for CIC-kategori F. Hvis der er 100 % sikkerhedsstillelse for et kreditderivat, er det maksimale tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling, nul. |
| C0200 | Swap — Udgående beløbsstrømme | Beløb, der er afleveret i henhold til swapkontrakten (bortset fra præmier) i løbet af indberetningsperioden. Svarer til den rente, der er betalt for renteswaps, og de beløb, der er afleveret for valutaswaps, kreditswaps, total-afkast-swaps og andre swaps. I tilfælde, hvor afviklingen finder sted på nettobasis, indberettes kun en af posterne C0200 og C0210. |
| C0210 | Swap — Indgående beløbsstrømme | Beløb, der er modtaget i henhold til swapkontrakten (bortset fra præmier) i løbet af indberetningsperioden. Svarer til den rente, der er modtaget for renteswaps, og de beløb, der er modtaget for valutaswaps, kreditswaps, total-afkast-swaps og andre swaps. I tilfælde, hvor afviklingen finder sted på nettobasis, indberettes kun en af posterne C0200 og C0210. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|--|
| C0220 | Begyndelsesdato | <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken forpligtelserne i henhold til aftalen får virkning.</p> <p>Hvis der optræder forskellige datoer for det samme derivat, indberettes kun den første handelsdato for derivatet og kun én række for hvert derivat (ikke forskellige rækker for hver handel), som afspejler det samlede beløb, der er investeret i dette derivat, idet der tages hensyn til de forskellige handelsdatoer.</p> <p>I tilfælde af nyordning bliver datoen for nyordningen handelsdatoen for dette derivat.</p> |
| C0230 | Varighed | <p>Derivatvarighed — defineret som den resterende modificerede varighed — for derivater, for hvilke et varighedsmål er relevant.</p> <p>Beregnet som nettovarigheden mellem ind- og udgående strømme fra derivatet, hvis det er relevant.</p> |
| C0240 | Solvens II-værdi | Derivatets værdi på indberetningsdatoen beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF. Den kan være positiv, negativ eller nul. |
| C0250 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte derivater. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver eller forpligtelser</p> <p>2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver eller forpligtelser</p> <p>3 — Alternative værdiansættelsesmetoder</p> <p>6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|---------------------|--|
| C0040 | Derivat-ID-kode | <p>Derivat-ID-kode i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0050 | Derivat-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Derivat-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------|--|
| | | <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> |
| C0260 | Modpartens navn | <p>Navnet på derivatets modpart. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — navnet på børsmarkedet for børshandlede derivater eller — navnet på den centrale modpart for over the counter-derivater, hvis de cleares gennem en central modpart, eller — navnet på den kontraktmæssige modpart for de øvrige over the counter-derivater. |
| C0270 | Modpartskode | <p>Modpartens identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI, hvis tilgængelig — Kode, der tildeles af selskabet, når LEI ikke er tilgængelig; koden skal være konsistent over tid <p>Denne post gælder alle modparter, inklusive derivater, der er clearet gennem en central modpart, i hvilket tilfælde modpartskoden henviser til den pågældende centrale modpart.</p> |
| C0280 | Modpartskodetype | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Modpartskode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0290 | Ekstern rating | <p>Kun relevant for over the counter-derivater.</p> <p>Vurderingen af modparten i derivatet pr. referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Denne post er ikke relevant for derivater, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>Hvis der ikke foreligger en udstedervurdering, udfyldes denne post ikke.</p> |
| C0300 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0290, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <ul style="list-style-type: none"> — Denne post indberettes, når »Ekstern vurdering« (C0290) indberettes. |
| C0310 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt derivatets modpart, jf. artikel 109a, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|--|
| | | <p>Denne post er ikke relevant for derivater, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |
| C0320 | Intern vurdering | <p>Intern vurdering af derivater for selskaber, der bruger interne vurderinger</p> <p>For selskaber, der anvender matchtilpasning, indberettes den interne vurdering, i det omfang de interne vurderinger anvendes til beregning af det grundlæggende spread, jf. artikel 77c, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF.</p> |
| C0330 | Modpartsgruppe | <p>Kun relevant for over the counter-derivater, vedrørende andre kontraktmæssige modparter end børsmarkeder og centrale modparter.</p> <p>Navnet på modpartens øverste moderselskab. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> |
| C0340 | Modpartsgruppekode | <p>Kun relevant for over the counter-derivater, vedrørende andre kontraktmæssige modparter end børsmarkeder og centrale modparter.</p> <p>Modpartens identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI, hvis tilgængelig — Kode, der tildeles af selskabet, når LEI ikke er tilgængelig; koden skal være konsistent over tid <p>Hvis den ikke finder anvendelse, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0350 | Type modpartsgruppekode | <p>Angiv, hvilken kodetype der anvendes under »Modpartsgruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0360 | Kontraktnavn | Navnet på derivatkontrakten. |
| C0370 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for derivatets valuta, dvs. valutaen for derivatets notionelle beløb (f.eks.: optioner, der som underliggende beløb har et beløb i USD, valutaer, for hvilke det notionelle beløb er kontraktmæssigt angivet for valutaswaps osv.).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0371 | Valuta for prisen | ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for prisen på derivatet angives, dvs. valutaen for det beløb, der veksles i forhold til derivatets notionelle værdi. For eksempel, hvis selskabet betaler (eller får) valuta A for det notionelle beløb (valuta B), så er valutaen for prisen A. Valutaen for det notionelle beløb er B, som indberettes i (C0370). |
| C0380 | CIC | Den CIC-kode, der bruges til at klassificere aktiver, jf. bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når derivater klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som derivatet er eksponeret for. |
| C0390 | Den udløsende værdi | Referencepris for futures, striking-pris for optioner (for obligationer skal prisen være en procentdel af pariværdien), valutakurs eller rente for forwards osv. Ikke relevant for CIC D3 — Rente- og valutaswaps. Udfyldes ikke for CIC F1 — Credit default swaps, hvis det ikke er muligt. Hvis der over tid er mere end én den udløsende værdi, indberettes den efterfølgende udløsende værdi, der forekommer. Hvis et derivat har en række udløsende værdier, indberettes sættet adskilt af »«, hvis rækken ikke er fortløbende, og adskilt af »-«, hvis den er fortløbende. |
| C0400 | Udløsende værdi, der fører til afvikling af kontrakten | Den hændelse, der fører til afviklingen af kontrakten, ud over almindelige udløbs- eller kontraktbetingelser, anføres. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Den underliggende enheds eller referenceenhedens konkurs 2 — Ugunstigt fald i det underliggende referenceaktivs værdi 3 — Ugunstig ændring i de underliggende aktivers eller den underliggende enheds kreditvurdering 4 — Nyordning, dvs. det at erstatte en derivatforpligtelse med en ny forpligtelse eller at erstatte en part i en derivatkontrakt med en ny part 5 — Mange hændelser eller en kombination af hændelser 6 — Andre hændelser ikke omfattet af foregående valgmuligheder 9 — Ingen udløsende værdi, der fører til afvikling |
| C0430 | Udløbsdato | Angiv den kontraktligt fastsatte ISO 8601-kode (åååå-mm-dd) for datoen for derivatkontraktens afslutning, hvad enten det er forfaldsdatoen, udløbsdatoen for optioner (europæiske eller amerikanske) osv. |
| C0440 | Swap, leveret | Angiv, hvad selskabet leverer i henhold til swapaftalen (f.eks. Euribor + 0,5 %, 2,3 %, EUR). |
| C0450 | swap modtaget | Angiv, hvad selskabet modtager i henhold til swapaftalen (f.eks. Euribor + 0,5 %, 2,3 %, EUR). |

S.09.01 — Oplysninger om gevinster/indtægter og tab i perioden

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indeholder oplysninger om gevinster/indtægter efter aktivkategori (herunder derivater), dvs. der kræves ikke »post-for-post«-indberetning. De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0040 | Aktivkategori | Angiv aktivkategorierne i porteføljen. Anvend de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier. |
| C0050 | Portefølje | Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, andre interne fonde, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde. Gevinster/indtægter og tab for underliggende aktiver vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og gevinster/indtægter og tab for underliggende aktiver vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed). En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Livsforsikring 2 — Skadesforsikring 3 — Ring-fenced fonde 4 — Andre interne fonde 5 — Aktiekapital 6 — Overordnet Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes. |
| C0060 | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | Angiv de aktiver, der besiddes i unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Unit-linked eller indeksreguleret 2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret |
| C0070 | Udbytte | Udbytteindtægter i indberetningsperioden, dvs. modtaget udbytte minus retten til at modtage et udbytte, som allerede er indregnet ved indberetningsperiodens begyndelse, plus retten til at modtage et udbytte indregnet ved indberetningsperiodens afslutning. Relevant for udbyttebetalende aktiver som f.eks. aktier, foretrukne værdipapirer og kollektive investeringsinstitutter. Omfatter også udbytter modtaget fra aktiver, der er solgt eller udløbet. |
| C0080 | Renter | Renteindtægter, dvs. modtagne renter minus påløbne renter ved indberetningsperiodens begyndelse plus påløbne renter ved indberetningsperiodens afslutning. Heri medregnes modtagne renter, når aktivet sælges/udløber, eller når kuponen modtages. Kun relevant for aktiver med kupon- og rentebetaling som f.eks. obligationer, lån og indskud. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|---|
| C0090 | Leje | Lejeindtægter, dvs. modtaget leje minus optjent leje ved indberetningsperiodens begyndelse plus optjent leje ved indberetningsperiodens afslutning. Heri medregnes også modtaget leje, når aktivet sælges eller afhændes. Kun relevant for ejendomme uanset funktion. |
| C0100 | Nettogevinster og -tab | Nettogevinster og -tab hidrørende fra aktiver, der er solgt eller udløbet i løbet af indberetningsperioden. Gevinster og tab beregnes som forskellen mellem værdi ved salg eller udløb og værdien i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af det foregående indberetningsår (eller for aktiver, der er erhvervet i løbet af indberetningsperioden, anskaffelsværdien). Nettoværdien kan være positiv, negativ eller nul. Beregningen skal foretages uden påløbne renter. |
| C0110 | Urealiserede gevinster og tab | Urealiserede gevinster og tab hidrørende fra aktiver, der ikke er solgt eller udløbet i løbet af indberetningsperioden. De urealiserede gevinster og tab beregnes som forskellen mellem værdi i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af indberetningsåret og værdi i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af det foregående indberetningsår (eller for aktiver, der er erhvervet i løbet af indberetningsperioden, anskaffelsværdien). Nettoværdien kan være positiv, negativ eller nul. Beregningen skal foretages uden påløbne renter. |

S.10.01 — Værdipapirudlån og -genkøb

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over transaktioner med udlån af værdipapirer og genkøbsaftaler (køber og sælger), der besiddes direkte af selskabet (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), hvilket også omfatter likviditetsswaps som omhandlet i artikel 309, stk. 2, litra f), i delegeret forordning (EU) 2015/35.

Det indgives kun, når værdien af de underliggende balanceførte og ikkebalanceførte værdipapirer i udlåns- eller genkøbsaftaler med en forfaldsdato efter referencedatoen for indberetningen udgør mere end 5 % af de samlede investeringer indberettet under post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01.

Alle kontrakter, der er balanceført eller ikkebalanceført, skal indberettes. Oplysningerne skal omfatte alle kontrakter i indberetningsperioden, uanset om de var åbne eller afsluttede på indberetningsdatoen. For så vidt angår kontrakter, der er del i en rollover-strategi, hvor de i vidt omfang udgør samme transaktion, indberettes kun åbne positioner.

En genkøbsaftale (repo) defineres som salg af værdipapirer ledsaget af en aftale om sælgers tilbagekøb af værdipapirerne på et senere tidspunkt. Værdipapirudlån defineres som udlån af værdipapirer fra en part til en anden, hvilket kræver, at låntageren stiller sikkerhed over for långiveren.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Hver genkøbs- og værdipapirudlånskontrakt skal indberettes i så mange rækker som nødvendigt for at fremlægge de ønskede oplysninger. Hvis der for én post, er én option, der passer til den ene del af det indberettede instrument, og en anden option, der passer til den anden del, så skal kontrakten opsplittes, medmindre andet er fastsat i vejledningen.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|--|
| C0040 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde. Underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Livsforsikring 2 — Skadesforsikring 3 — Ring-fenced fonde 4 — Andre interne fonde 5 — Aktiekapital 6 — Overordnet <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> <p>For aktiver, der ikke balanceføres, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0050 | Fondsnummer | <p>Gælder for aktiver i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret i henhold til nationale markeder, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.06.02 og S.14.01). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> <p>Fondsnummeret er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed.</p> |
| C0060 | Aktivkategori | <p>Angiv aktivkategorierne for det underliggende aktiv, der er udlånt/stillet som sikkerhed i forbindelse med transaktioner med udlån af værdipapirer eller genkøbsaftaler.</p> <p>Anvend de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning.</p> |
| C0070 | Modpartens navn | <p>Navnet på kontraktens modpart</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> |
| C0080 | Modpartskode | <p>Angiv identifikationskoden for modparten ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0090 | Modpartskodetype | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Modpartskode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 9 — Ingen |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0100 | Kategori for modpartens aktiv | Angiv den vigtigste aktivkategori, der er lånt/modtaget i forbindelse med transaktioner med udlån af værdipapirer eller genkøbsaftaler. Anvend de aktivkategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning. |
| C0110 | Aktiver, der besiddes i forbindelse med unit-linked aftaler og indeksregulerede aftaler | Angiv, om det underliggende aktiv defineret i C0060 besiddes i forbindelse med unit-linked aftaler og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Unit-linked eller indeksreguleret 2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret |
| C0120 | Position i kontrakten | Angiv, om selskabet er køber eller sælger i genkøbsaftalen eller långiver eller låntager i værdipapirudlånsaftalen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Køber i en repo 2 — Sælger i en repo 3 — Långiver i en værdipapirudlånsaftale 4 — Låntager i en værdipapirudlånsaftale |
| C0130 | Near leg-beløb | Repræsenterer følgende beløb: — Køber i en repo: modtaget beløb ved aftalens indgåelse — Sælger i en repo: cederet beløb ved aftalens indgåelse — Långiver i en værdipapirudlånsaftale modtaget beløb som garanti ved aftalens indgåelse — Låntager i en værdipapirudlånsaftale beløb eller markedsværdi af værdipapirer modtaget ved aftalens indgåelse |
| C0140 | Far leg-beløb | Denne post er kun relevant for genkøbsaftaler og præsenterer følgende beløb: — Køber i en repo: cederet beløb ved aftalens udløb — Sælger i en repo: modtaget beløb ved aftalens udløb |
| C0150 | Startdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for kontraktens startdato. Kontraktens startdato refererer til den dato, på hvilken forpligtelserne i henhold til kontrakten får virkning. |
| C0160 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for kontraktens slutdato. Selv om aftalen er uden fast løbetid, udløber den normalt på en bestemt dato. I disse tilfælde skal denne dato indberettes, hvis der ikke forekommer en opsigelse inden da. En aftale anses for afsluttet, når den er udløbet, når den er opsagt, eller når den annulleres. For kontrakter uden fastsat forfaldsdato angives »9999-12-31«. |
| C0170 | Solvens II-værdi | Denne post er kun relevant for kontrakter, som stadig er åbne på indberetningsdatoen. Værdi af genkøbs- eller værdipapirudlånskontrakten i henhold til bestemmelserne i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF om værdiansættelse af kontrakter. Denne værdi kan være positiv, negativ eller nul. |

S.11.01 — Aktiver, der besiddes som sikkerhed*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes årlig, men kun når andelen af de aktiver, der besiddes som sikkerhed, i forhold til den samlede balance overstiger 10 %.

En aktiepulje, som sikrer investeringen (f.eks. den aktiepulje, der er sikkerhed for dækkede obligationer), indberettes ikke i dette skema. Den sikkerhedsstillelse, der dækker tilgodehavender fra genforsikring, indberettes i skema S.11.01.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over ikkebalanceførte aktiver, der besiddes som sikkerhed, og som dækker balanceførte aktiver, der besiddes direkte af selskabet (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) ved udgangen af indberetningsperioden. Ved sikkerhed, »der besiddes«, forstås, når selskabet har »ret til direkte adgang til sikkerheden«, således at der er givet tilsagn om sikkerheden til enheden, og at den kan identificeres enkeltvis.

Det indeholder detaljerede oplysninger hvad angår aktiver, der besiddes som sikkerhed, og ikke hvad angår aftalen om sikkerhedsstillelse.

Hvis der findes en sikkerhedsstillelsepulje eller en aftale om sikkerhedsstillelse, der omfatter mange aktiver, indberettes lige så mange rækker, som der er aktiver i puljen eller aftalen.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om aktiver.

I tabellen »Oplysninger om positioner« skal hvert aktiv, der besiddes som sikkerhed, indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede variabler i tabellen. Hvis der for det samme aktiv kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende aktiv indberettes i mere end én række. »Fast ejendom, der besiddes som sikkerhed for realkreditlån til fysiske personer, skal indberettes i én række.

I tabellen »Oplysninger om aktiver« skal hvert aktiv, der besiddes som sikkerhed, indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Alle poster undtagen »Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes« (C0140), »Navn på den modpart, der stiller sikkerheden« (C0060) og »Navn på den modpartsgruppe, der stiller sikkerheden« (C0070) vedrører oplysninger om aktiver, der besiddes som sikkerhed. Post C0140 vedrører det balanceførte aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes, mens post C0060 og C0070 vedrører den modpart, der stiller sikkerheden.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Skema S.11.01 indeholder de ikkebalanceførte aktiver, der besiddes som sikkerhed for balanceførte aktiver, som besiddes direkte af selskabet, og disse værdier skal også indberettes i S.03.01 i C0020/R0100 til R0130.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Oplysninger om positioner, der besiddes

| | | |
|-------|---------------|---|
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
|-------|---------------|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0060 | Navnet på den sikkerhedsstillende modpart | <p>Navnet på den modpart, der stiller sikkerheden. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Hvis det balanceførte aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes, er policelån, indberettes »Forsikringstager«.</p> |
| C0070 | Navnet på den sikkerhedsstillende modpartsgruppe | <p>Angiv den økonomiske modpartsgruppe, der stiller sikkerheden. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis de balanceførte aktiver, for hvilke sikkerheden besiddes, er policelån.</p> |
| C0080 | Deponeringsland | <p>»ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor selskabet har deponerede aktiver. Med henblik på identificering af internationale depositarer, som f.eks. Euroclear, er deponeringslandet det land, hvor der er indgået aftale om deponering.</p> <p>Hvis det samme aktiv er deponeret i mere end ét land, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle deponeringslande.</p> <p>Denne post er ikke relevant for sikkerhed i CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75 og for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver.</p> <p>Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), fastslås udstederlandet ud fra ejendommens adresse.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0090 | Mængde | <p>Antal aktiver, for alle aktiver, hvor det er relevant.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Pariværdi« (C0100) indberettes.</p> |
| C0100 | Pariværdi | <p>Udestående beløb målt til pariværdi, for alle aktiver, hvor denne post er relevant, og til nominel værdi for CIC = 72, 73, 74, 75, 79 og 8. Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 71 og 9. Denne post indberettes ikke, hvis posten »Mængde« (C0090) indberettes.</p> |
| C0110 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte aktiver. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver 2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver 3 — Alternative værdiansættelsesmetoder 4 — Justeret indre værdis metode (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser) 5 — Indre værdis metode i henhold til IFRS (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser) 6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35 |
| C0120 | Samlet beløb | <p>Værdi beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, svarende til:</p> <ul style="list-style-type: none"> — »Pariværdi« (udestående hovedstol målt til pariværdi eller nominel værdi) ganget med »Procentsats af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« plus »Påløbne renter«, for aktiver, hvor de første to poster er relevante — »Mængde« ganget med »Solvens II-pris pr. enhed«, for aktiver, hvor disse to poster er relevante — Solvens II-værdien af aktiverne for aktiver, der kan klassificeres under aktivkategori 71 og 9. |
| C0130 | Påløbne renter | <p>Angiv værdien af påløbne renter efter den sidste kupondato for rentebærende værdipapirer. Bemærk, at denne værdi også er en del af posten »Samlet beløb«.</p> |
| C0140 | Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes | <p>Angiv type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Statsobligationer 2 — Erhvervsobligationer 3 — Egenkapital 4 — Kollektive investeringsinstitutter 5 — Strukturerede værdipapirer 6 — Sikrede værdipapirer 7 — Kontanter og indskud 8 — Lån, herunder realkreditlån 9 — Ejendomme |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|--|
| | | <p>0 — Øvrige investeringer (herunder tilgodehavender)</p> <p>X — Derivater</p> <p>F.eks. vælges »0 — Øvrige investeringer« for den sikkerhedsstillelse, der dækker tilgodehavender fra genforsikring.</p> |
| | POST | VEJLEDNING |

Oplysninger om aktiver

| | | |
|-------|-------------------|--|
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------|---|
| C0150 | Betegnelse for posten | <p>Angiv den indberettede post ved at videregive de af selskabet fastsatte oplysninger om navnet på aktivet (eller adresse, hvis det drejer sig om ejendom).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, skal denne post, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. Lån til andre end fysiske personer indberettes række for række. — Denne post er ikke relevant for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, eller for CIC 71 og CIC 75. — Hvis sikkerhedsstillelsen omfatter forsikringspolicer (vedrørende lån med sikkerhedsstillelse i forsikringspolicer), er det ikke nødvendigt, at disse policer individualiseres, og denne post er ikke relevant. — For ejendomme indberettes ISO-landekoden alpha-2 + postnummer + by + gadenavn + husnummer) for den ejendom, der besiddes, eller den bredde- og længdegrad eller den CRESTA-/NUTS-region, hvor ejendomsinvesteringen finder sted: administrative grænser (f.eks. provins- eller distriktsgrænse f.eks. NUTS3-niveau) eller sammenlagte postkodeområder (f. eks. de første to tal er postkodeområder, i lighed med de såkaldte »low resolution zones« i CRESTA (Catastrophe Risk Evaluation and Standardising TARGET Accumulations) 2019[2]). |
| C0160 | Udsteders navn | <p>Navnet på udstederen, som er defineret som den enhed, der udsteder aktiver, som repræsenterer en del af dens kapital, en del af dens gæld, derivater osv., til investorer.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederens navn navnet på fondsforvalteren. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederens navn navnet på depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, skal denne post, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter deres art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. — Hvad angår CIC 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren. <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0170 | Udstederkode | <p>Angiv identifikationskoden for udstederen ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederkoden koden for fondsforvalteren. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederkoden koden for depositaren. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|--|
| | | <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> |
| C0180 | udstederkodetype | <p>Angiv, hvilken udstederkode der anvendes under »Udstederkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0190 | Udstedersektor | <p>Angiv udstederens økonomiske sektor på grundlag den seneste udgave af NACE-koderne (som offentliggjort i en EF-forordning). For NACE-hovedafdelinger A til N kræves der ved fuld indberetning firecifrede NACE-koder, dvs. bogstavet for hovedafdelingen, efterfulgt af den firecifrede kode for kategorien (f.eks. »K6411«). For de resterende hovedafdelinger anvendes bogstavreferencen i NACE-koden, hvorved hovedafdelingen identificeres, som et minimum til identifikation af sektorer (f.eks. ville »P« eller »P8501« kunne godtages).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstedersektoren den sektor, som fondsforvalteren tilhører.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstedersektoren den sektor, som depositaren tilhører.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> |
| C0200 | Udstedergruppenavn | <p>Navnet på udstederens øverste moderselskab.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter henfører grupperelationen til fondsforvalteren.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, henfører grupperelationen til låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer). — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |
| C0210 | Udstedergruppekode | <p>Angiv udstedergruppens identifikationskode ved hjælp af LEI, hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter henfører grupperelationen til fondsforvalteren. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, henfører grupperelationen til låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer). <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0220 | Type udstedergruppekode | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Udstedergruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0230 | Udstederland | <p>ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor udstederen befinder sig.</p> <p>Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter er udstederlandet fondsforvalterens land. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstederlandet depositarens land. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode — XA: Supranationale udstedere — EU: Den Europæiske Unions institutioner |
| C0240 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres), CIC 75 og CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug) af samme grund. — Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer valuta til den valuta, som investeringen blev foretaget i. |
| C0250 | CIC | <p>Den CIC-kode, der bruges til at klassificere aktiver, jf. bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når et aktiv klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som aktivet er eksponeret for.</p> |
| C0260 | Pris pr. enhed | <p>Pris pr. enhed for aktivet, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« (C0270) indberettes.</p> |
| C0270 | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i procent af pariværdi, »clean price« uden påløbne renter, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »pariværdi« (C0100) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«), undtagen for CIC-kategori 71 og 9.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Solvens II-pris pr. enhed« (C0260) indberettes.</p> |
| C0280 | Udløbsdato | <p>Kun relevant for CIC-kategori 1, 2, 5, 6 og 8 samt CIC 74 og CIC 79.</p> <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for forfaldsdatoen.</p> <p>Svarer altid til forfaldsdatoen, selv for værdipapirer, som kan kræves indkaldt.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For værdipapirer uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«. — For CIC-kategori 8 vedrørende lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer indberettes den vægtede (på basis af lånebeløbet) restløbetid. |

S.12.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced funds, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Selskaber kan anvende relevante approksimative størrelser til beregning af forsikringsmæssige hensættelser som omhandlet i artikel 21 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Endvidere kan artikel 59 i delegeret forordning (EU) 2015/35 anvendes til at beregne risikomarginen i løbet af regnskabsåret.

Branche for livsforsikringsforpligtelser: De i artikel 80 i direktiv 2009/138/EF omhandlede brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Segmenteringen skal afspejle arten af kontraktens underliggende risici (substans) og ikke kontraktens juridiske form (form). Hvis en forsikrings- eller genforsikringsaftale som standard dækker risici på tværs af brancher opsplittes om muligt forpligtelserne i de relevante brancher (artikel 55 i delegeret forordning (EU) 2015/35).

Brancherne »Indeksreguleret og unit-linked forsikring«, »Anden livsforsikring« og »Sygeforsikring« opdeles mellem »Kontrakter uden optioner og garantier« og »Kontrakter med optioner eller garantier«. I forbindelse med denne opdeling tages følgende i betragtning:

- I »Kontrakter uden optioner og garantier« medregnes de beløb, der er relateret til kontrakterne uden eventuelle finansielle garantier eller aftalebestemte optioner, hvilket vil sige, at beregningen af de forsikringsmæssige hensættelser ikke afspejler værdien af eventuelle finansielle garantier eller aftalebestemte optioner. Kontrakter med ikke væsentlige aftalebestemte optioner eller finansielle garantier, som ikke er afspejlet i beregningen af de forsikringsmæssige hensættelser, skal også indberettes i denne kolonne.
- I »Kontrakter med optioner og garantier« medregnes kontrakter, som enten har finansielle garantier, aftalebestemte optioner eller begge, for så vidt som beregningen af de forsikringsmæssige hensættelser afspejler, at der findes disse finansielle garantier eller aftalebestemte optioner.

De indberettede oplysninger skal være uden fradrag af genforsikring, da oplysninger om beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, kræves indberettet i særlige rækker.

Henvisninger til genkøbsværdi gælder ikke for genforsikringsvirksomhed.

De oplysninger, der skal indberettes mellem R0010 og R0100, skal være efter volatilitetsjustering, matchtilpasning og overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve, hvis den anvendes, men må ikke omfatte overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser kræves indberettet separat mellem række R0110 og R0130.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| Z0020 | Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et

| | | |
|--|---|---|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0110, C0120, C0130, C0140, C0160, C0190 og C0200/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked). |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| C0210/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100 to C0140, C0160, C0190 og C0200/R0020 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0020 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0020 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af et bedste skøn og en risikomargin

| | | |
|---|---|--|
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100 til C0140, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af det bedste skøn og risikomarginen, bedste bruttoskøn | Bedste bruttoskøn (uden fradrag af genforsikring, SPV'er og finite reinsurance i henhold til artikel 77, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF) for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af det bedste skøn og risikomarginen, bedste bruttoskøn — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af bedste bruttoskøn (uden fradrag af genforsikring, SPV'er og finite reinsurance i henhold til artikel 77, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF), for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| C0210/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af det bedste skøn og risikomarginen, bedste bruttoskøn — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af bedste bruttoskøn (uden fradrag af genforsikring, SPV'er og finite reinsurance i henhold til artikel 77, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF), for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0040 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | Beløb, der kan tilbagekræves inden justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, herunder cederet koncernintern genforsikring, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0040 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves inden justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, herunder cederet koncernintern genforsikring, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0040 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er inden justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0050 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab | Beløb, der kan tilbagekræves (inden justeringen for forventede tab) fra »traditionel genforsikring«, dvs. uden SPV'er og finite reinsurance, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, herunder cederet koncernintern genforsikring, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0050 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves (inden justeringen for forventede tab) fra »traditionel genforsikring«, dvs. uden SPV'er og finite reinsurance, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, herunder cederet koncernintern genforsikring, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|---|
| C0210/R0050 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) inden justeringen for forventede tab, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0060 | Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab | Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, herunder cederet koncernintern genforsikring, for hver branche. |
| C0150/R0060 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0060 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er inden justeringen for forventede tab, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0070 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, herunder cederet koncernintern genforsikring, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0070 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra finite reinsurance inden justeringen for forventede tab — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab, beregnet i overensstemmelse med rammerne i de aftaler, som disse beløb vedrører, herunder cederet koncernintern genforsikring, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0070 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves fra finite reinsurance inden justeringen for forventede tab — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance inden justeringen for forventede tab, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100 til C0140, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0080 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | Beløb, der kan tilbagekræves efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, herunder cederet koncernintern genforsikring, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0080 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, herunder cederet koncernintern genforsikring, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0080 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af beløb, der kan tilbagekræves efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, herunder cederet koncernintern genforsikring, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0090 | Det bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance | Bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, for hver branche. |
| C0150/R0090 | Det bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af det bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0090 | Det bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af det bedste skøn minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af sandsynligheden for misligholdelse fra genforsikrerens side, jf. artikel 81 i direktiv 2009/138/EF, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100 to C0140, C0160, C0190 og C0200/R0100 | Risikomargin | Værdi for risikomargin i henhold til artikel 77, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF) for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0100 | Risikomargin — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af risikomargin, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0100 | Risikomargin — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af risikomargin for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser

| | | |
|---|---|--|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0110 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokert til forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, for hver branche. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0150/R0110 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokert til forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0210/R0110 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokert til forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for sygeforsikring svarende til livsforsikring. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020, C0040, C0050, C0070, C0080, C0090, C0100, C0170, C0180, C0190 og C0200/R0120 | Det bedste skøn | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokert til det bedste skøn, for hver branche. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0150/R0120 | Det bedste skøn — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Det samlede overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser allokeret til det bedste skøn, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0210/R0120 | Det bedste skøn — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Det samlede overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser allokeret til det bedste skøn, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0130 | Risikomargin | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokeret til risikomargin, for hver branche. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0150/R0130 | Risikomargin — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Det samlede overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser allokeret til risikomarginen, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0210/R0130 | Risikomargin — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Det samlede overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser allokeret til risikomarginen, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |

Forsikringsmæssige hensættelser — i alt

| | | |
|--|---|---|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0200 | Forsikringsmæssige hensættelser — i alt | De samlede forsikringsmæssige hensættelser for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, inklusive forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0150/R0200 | Forsikringsmæssige hensættelser — i alt — (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0210/R0200 | Forsikringsmæssige hensættelser — i alt — (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser for sygeforsikring svarende til livsforsikring, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0110, C0120, C0130, C0140, C0160, C0190 og C0200/R0210 | Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, inklusive herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0150/R0210 | Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0210/R0210 | Forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — i alt — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, for sygeforsikring svarende til livsforsikring, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |

Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption

| | | |
|---|--|---|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160 og C0190/R0220 | Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption | Bedste bruttoskøn for produkter med en genkøbsoption, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi skal også medregnes i R0030-R0090. |
| C0150/R0220 | Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet bedste bruttoskøn for produkter med en genkøbsoption, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. Denne værdi skal også medregnes i R0030-R0090. |
| C0210/R0220 | Bedste skøn for produkter med en genkøbsoption — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet bedste bruttoskøn for produkter med en genkøbsoption, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. Denne værdi skal også medregnes i R0030-R0090. |

Det bedste bruttoskøn for cash flow

| | | |
|--|--|---|
| C0030, C0060, C0090, C0160, C0190, C0200/R0230 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab samt fremtidige garanterede og diskretionære ydelser | Beløbet for diskonterede likviditetstab (betalinger til forsikringstagere og begunstigede) for fremtidige garanterede ydelser og for fremtidige diskretionære ydelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Fremtidige diskretionære ydelser betyder andre fremtidige ydelser end indeksregulerede eller unit-linked ydelser i henhold til forsikrings- eller genforsikringsaftaler, som har ét af følgende karakteristika: a) De er juridisk eller kontraktmæssigt baseret på et eller flere af følgende resultater: i. opfyldelsen af en nærmere angivet gruppe af aftaler eller en nærmere angivet type af aftaler eller en enkelt aftale ii. det realiserede eller urealiserede afkast på en bestemt pulje af aktiver, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet er indehaver af iii. forsikrings- eller genforsikrings-selskabets eller fondens fortjeneste eller tab i henhold til aftalen. b) Ydelserne er baseret på en erklæring fra forsikrings- eller genforsikrings-selskabet, og ydelsernes udbetalingstidspunkt eller beløb afhænger helt eller delvist af selskabets skøn. |
|--|--|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0150/R0230 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsel, fremtidige garanterede og diskretionære ydelser — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet beløb for diskonterede likviditetstab (betalinger til forsikringstagere og begunstigede) for fremtidige garanterede ydelser og for fremtidige diskretionære ydelser for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0230 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige garanterede og diskretionære ydelser — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet beløb for diskonterede likviditetstab (betalinger til forsikringstagere og begunstigede) for fremtidige garanterede ydelser og for fremtidige diskretionære ydelser for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0100/R0240 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab samt fremtidige garanterede ydelser | Det diskonterede likviditetstab (betalinger til forsikringstagere og begunstigede) for fremtidige garanterede ydelser. Hvad angår C0020/R0240, indberettes branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35 »Forsikring med gevinstandele«. Hvad angår C0100/R0240, indberettes alle fremtidige garanterede ydelser vedrørende accepteret genforsikring uanset branchen. |
| C0150/R0240 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsel, fremtidige garanterede ydelser — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi for det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsel, fremtidige garanterede ydelser — anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0020, C0100/R0250 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige diskretionære ydelser — forsikring med gevinstandele | <p>Værdi af diskonterede likviditetstab (betalinger til forsikringstagere og begunstigede) for fremtidige diskretionære ydelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, »Forsikring med gevinstandele«.</p> <p>Fremtidige diskretionære ydelser betyder andre fremtidige ydelser end indeksregulerede eller unit-linked ydelser i henhold til forsikrings- eller genforsikringsaftaler, som har ét af følgende karakteristika:</p> <ol style="list-style-type: none"> a) De er juridisk eller kontraktmæssigt baseret på et eller flere af følgende resultater: <ol style="list-style-type: none"> i. opfyldelsen af en nærmere angivet gruppe af aftaler eller en nærmere angivet type af aftaler eller en enkelt aftale ii. det realiserede eller urealiserede afkast på en bestemt pulje af aktiver, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet er indehaver af iii. forsikrings- eller genforsikrings-selskabets eller fondens fortjeneste eller tab i henhold til aftalen. b) Ydelserne er baseret på en erklæring fra forsikrings- eller genforsikrings-selskabet, og ydelsernes udbetalingstidspunkt eller beløb afhænger helt eller delvist af selskabets skøn. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| C0150/R0250 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige diskretionære ydelser — forsikring med gevinstandele — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi for det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige garanterede ydelser — forsikring med gevinstandele for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0260 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab | Værdi af diskonterede likviditetstab for fremtidige udgifter og andre likviditetstab, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Skal afspejle udgifter forbundet med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikrings- eller genforsikringsforpligtelserne. |
| C0150/R0260 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af diskonterede likviditetstab og fremtidige udgifter og andre likviditetstab, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. Skal afspejle udgifter forbundet med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikrings- eller genforsikringsforpligtelserne. |
| C0210/R0260 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af diskonterede likviditetstab og fremtidige udgifter og andre likviditetstab, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. Skal afspejle udgifter forbundet med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikrings- eller genforsikringsforpligtelserne. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0270 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsel, fremtidige præmier | Beløbet for diskonterede likviditetstilførsler fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som følger af disse præmier, herunder præmier for accepteret genforsikring, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0270 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsel, fremtidige præmier — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Beløbet for diskonterede likviditetstilførsler fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som følger af disse præmier, herunder præmier for accepteret genforsikring, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0270 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsler, fremtidige præmier — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Beløbet for diskonterede likviditetstilførsler fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som følger af disse præmier, herunder præmier for accepteret genforsikring, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0280 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler | Værdi af alle øvrige diskonterede likviditetstab, der ikke indgår i fremtidige præmier, og uden investeringsafkast, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0150/R0280 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Værdi af eventuelle andre diskonterede likviditetstilførsler ikke medtaget i fremtidige præmier og uden investeringsafkast, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0280 | Det bedste bruttoskøn for cash flow, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Værdi af eventuelle andre diskonterede likviditetstilførsler ikke medtaget i fremtidige præmier og uden investeringsafkast, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0290 | Procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | Angiv procentdelen af det bedste bruttoskøn medtaget i bedste bruttoskøn (R0030) beregnet ved hjælp af approksimative størrelser som fastsat i artikel 21 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for hver branche. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0300 | Genkøbsværdi | Angiv genkøbsværdien, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, jf. artikel 185, stk. 3, litra f), i direktiv 2009/138/EF, med fradrag af skatter. Skal afspejle det kontraktligt fastsatte beløb, der skal betales til forsikringstageren i tilfælde af opsigelse af aftalen før tid (dvs. før forsikringen kommer til udbetaling ved udløb, eller før forsikringsbegivenheden indtræffer, f.eks. dødsfald), med fradrag af afgifter og policelån. Det omfatter garanterede og ikkegaranterede genkøbsværdier. |
| C0150/R0300 | Genkøbsværdi, i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Den samlede genkøbsværdi for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked). |
| C0210/R0300 | Genkøbsværdi, i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet genkøbsværdi for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0310 | Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Angiv værdien af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0310 | Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0310 | Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|--|
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0320 | Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | <p>Beløbet for forsikringsmæssige hensættelser, hvor overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve er anvendt, beregnet uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af volatilitetsjusteringen, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med volatilitetsjusteringen.</p> |
| C0150/R0320 | Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | <p>Samlet værdi af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked.</p> <p>I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af volatilitetsjusteringen, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med volatilitetsjusteringen.</p> |
| C0210/R0320 | Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | <p>Samlede forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for sygeforsikring svarende til livsforsikring.</p> <p>I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af volatilitetsjusteringen, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med volatilitetsjusteringen.</p> |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0330 | Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | Angiv værdien af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til volatilitetsjusteringen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0330 | Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til volatilitetsjustering, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0330 | Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til volatilitetsjustering, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0340 | Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | <p>Beløbet for forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden volatilitetsjustering, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden volatilitetsjusteringen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| C0150/R0340 | Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden overgangsforanstaltninger — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden volatilitetsjustering for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden volatilitetsjusteringen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. |
| C0210/R0340 | Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden overgangsforanstaltninger — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden volatilitetsjustering for sygeforsikring svarende til livsforsikring. I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden volatilitetsjusteringen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0350 | Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning | Angiv værdien af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til matchtilpasningen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0350 | Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af det bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til matchtilpasning, for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0350 | Det bedste skøn under hensyn til matchtilpasning — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af bedste bruttoskøn (R0030) under hensyn til matchtilpasning, for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0360 | Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre | Beløbet for forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden matchtilpasning, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden matchtilpasningen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0150/R0360 | Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle øvrige — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden matchtilpasning for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden matchtilpasningen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0210/R0360 | Forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle øvrige — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden matchtilpasning for sygeforsikring svarende til livsforsikring. I de tilfælde, hvor de samme forsikringsmæssige hensættelser også var omfattet af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden matchtilpasningen og overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190 og C0200/R0370 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | Angiv beløbet for forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for hver branche, som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0370 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — i alt (anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked) | Samlet beløb for forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked. |
| C0210/R0370 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — i alt (sygeforsikring svarende til livsforsikring) | Samlet beløb for forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

S.12.02 — Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring og SLT-sygeforsikring — efter land

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder. Skemaet udfyldes ikke, når de nedenfor anførte tærskler for indberetning efter land ikke finder anvendelse, dvs. når hjemlandet tegner sig for 100 % eller mere af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet som helhed og det bedste bruttoskøn. Når dette beløb er over 90 %, men lavere end 100 %, indberettes kun R0010, R0020 og R0030.

Virksomheder skal tage hensyn til alle forpligtelserne i forskellige valutaer og omregne dem til indberetningsvalutaen.

Oplysningerne efter land skal indberettes i overensstemmelse med følgende:

- Oplysninger om hjemlandet skal altid indberettes uanset værdien af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn.
- Oplysninger indberettet efter land skal mindst udgøre 90 % af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for enhver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.
- Hvis der skal indberettes et bestemt land for en særlig branche for at opfylde litra b), skal det pågældende land indberettes for alle brancher.
- De øvrige lande skal indberettes aggregeret i »andre EØS« eller »andre ikke-EØS«.
- Med hensyn til direkte forsikringsvirksomhed skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor kontrakten blev indgået.
- Med hensyn til proportional og ikkeproportional genforsikring skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor det cederende selskab er beliggende.

I dette skema forstås ved »det land, hvor kontrakten blev indgået«:

- det land, hvor forsikringssselskabet er etableret (hjemland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial eller i henhold til reglerne om den frie udveksling af tjenesteydelser
- det land, hvor filialen er beliggende (værtland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial

- c) det land, hvor retten til fri udveksling af tjenesteydelser blev meddelt (værtsland), hvis kontrakten blev solgt i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser
- d) Hvis der blev anvendt en mægler, eller i enhver anden situation, gælder a), b) eller c), afhængigt af hvem der solgte kontrakten.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne eller landene skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskler.

De oplysninger, der skal indberettes, skal omfatte volatilitetsjustering, matchtilpasning, overgangsjustering på den relevante risikofrie rentekurve og overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser.

Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| C0010/R0040, | Lande inden for væsentlighedstærsklen | ISO 3166-1 alpha-2-landekoden indberettes for at identificere landene inden for væsentlighedstærsklen |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190, C0200,/R0010 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — hjemland | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter det land, hvor aftalen blev indgået, eller efter det land, hvor det cederende selskab befinder sig, hvis landet er hjemlandet, for hver branche og de samlede værdier for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked og sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190, C0200,/R0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), undtagen hjemlandet, for hver branche og de samlede værdier for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked og sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190, C0200,/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), undtagen hjemlandet, for hver branche og de samlede værdier for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked og sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0020, C0030, C0060, C0090, C0100, C0160, C0190, C0200,/R0040 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — Land 1 [én række for hvert land inden for væsentlighedstærsklen] | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter det land, hvor aftalen blev indgået, eller efter det land, hvor det cederende selskab befinder sig, for hvert af landene inden for væsentlighedstærsklen, undtagen hjemlandet, for hver branche og de samlede værdier for anden livsforsikring end sygeforsikring, herunder unit-linked og sygeforsikring svarende til livsforsikring. |

S.13.01 — Fremskrivning af fremtidige cash flow, opgjort brutto (bedste skøn — livsforsikring)

Generelle bemærkninger:

Denne del af bilag II vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal kun indeholde oplysninger vedrørende de bedste skøn. De cash flow, der skal indberettes, er uden fradrag af genforsikring og udiskonteret.

Cash flow-fremskrivninger, f.eks. centrale scenarier, kan anvendes, da der ikke kræves perfekt afstemning med beregning af det bedste skøn. Selskaber kan følge forskellige tilgange med henblik på at identificere fremtidige diskretionære ydelser. f.eks. sikkerhedsækvivalentscenariet eller et gennemsnit af alle betragtede scenarier. Hvis det er vanskeligt at fremskrive visse fremtidige cash flow, som f.eks. fremtidige diskretionære ydelser, skal selskabet indberette det cash flow, det i praksis anvender til beregning af det bedste skøn. Andre eksempler på komplekse fremskrivninger er genforsikringsaftaler, der dækker flere brancher. I det tilfælde bør allokering af cash flow for genforsikring efter branche være i overensstemmelse med den tilgang, der følges for at opsplitte de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler.

Alle cash flow udtrykt i forskellige valutaer skal tages i betragtning og omregnes til indberetningsvalutaen ved hjælp af vekselkursen på indberetningsdatoen.

Hvis selskabet anvender forenklinger ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser, for hvilke et skøn over de forventede fremtidige cash flow hidrørende fra kontrakterne ikke beregnes, skal oplysningerne ikke indberettes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0011/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring med gevinstandele.</p> |
| C0015/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring med gevinstandele.</p> |
| C0020/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring med gevinstandele.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som behandles inden for det samme selskab, skal også medtages.</p> |
| C0030/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring med gevinstandele.</p> |
| C0040/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring med gevinstandele.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0045/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, forsikring med gevinstandele (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0051/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indeksreguleret og unit-linked forsikring.</p> |
| C0055/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indeksreguleret og unit-linked forsikring.</p> |
| C0060/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indeksreguleret og unit-linked forsikring.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som behandles inden for det samme selskab, skal også medtages.</p> |
| C0070/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indeksreguleret og unit-linked forsikring.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0080/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indeksreguleret og unit-linked forsikring.</p> |
| C0085/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, indeksreguleret og unit-linked forsikring (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0091/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, anden livsforsikring.</p> |
| C0095/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, anden livsforsikring (brutto).</p> |
| C0100/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, anden livsforsikring.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som behandles inden for det samme selskab, skal også medtages.</p> |
| C0110/R0010-R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, anden livsforsikring.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0120/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, anden livsforsikring.</p> |
| C0125/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, anden livsforsikring (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0131/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler relateret til forsikringsforpligtelser, herunder sygeforsikringsforpligtelser.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som ikke skal medtages.</p> |
| C0135/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto).</p> |
| C0140/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, vedrørende branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler relateret til forsikringsforpligtelser, herunder sygeforsikringsforpligtelser.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som endnu ikke er afviklet som annuiteter, og som ændres til annuiteter og behandles inden for det samme selskab, skal også medtages.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0150/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som følger af disse præmier, vedrørende branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler relateret til forsikringsforpligtelser, herunder sygeforsikringsforpligtelser.</p> |
| C0160/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, vedrørende branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler relateret til forsikringsforpligtelser, herunder sygeforsikringsforpligtelser.</p> |
| C0165/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet kernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0171/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, accepteret genforsikring.</p> |
| C0175/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, accepteret genforsikring.</p> |
| C0180/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, accepteret genforsikring.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | | Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som behandles inden for det samme selskab, skal også medtages. |
| C0190/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, accepteret genforsikring.</p> |
| C0200/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, accepteret genforsikring.</p> |
| C0205/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, accepteret genforsikring (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0211/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygeforsikring.</p> |
| C0215/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygeforsikring (brutto).</p> |
| C0220/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygeforsikring.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0230/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygeforsikring</p> |
| C0240/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygeforsikring.</p> |
| C0245/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygeforsikring (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko.</p> |
| C0251/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige garanterede ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige garanterede ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygegenforsikring.</p> |
| C0255/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige diskretionære ydelser | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige diskretionære ydelser, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygegenforsikring.</p> |
| C0260/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | <p>Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50.</p> <p>Cash flowene er dem, der er forbundet med udgifter, som påløber i forbindelse med honoreringen af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges eller ventes at blive pålagt forsikringstagere, eller som skal foretages for at afregne forsikringsforpligtelserne, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygegenforsikring.</p> <p>Likviditetstab fra skadesforsikringsaftaler, som ændres til annuiteter, men som endnu ikke formelt er afviklet som annuiteter, og som behandles inden for det samme selskab, skal også medtages.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0270/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), likviditetstilførsler — fremtidige præmier | Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50. Cash flowene er dem, der hidrører fra fremtidige præmier og eventuelle yderligere cash flow, som hidrører fra disse præmier, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygegenforsikring. |
| C0280/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50. Cash flowene er dem, der ikke er medregnet i fremtidige præmier, og som ikke omfatter investeringsafkast, for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, sygegenforsikring. |
| C0285/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, sygegenforsikring (brutto), cash flow — Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringer) | Beløbet for udiskonterede cash flow i forbindelse med SLT-sygeforsikringsforpligtelser, forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50. De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko. |
| C0290/R0010–R0330 | Fremtidige cash flow anvendt i det bedste skøn, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Beløbet for udiskonterede cash flow i forbindelse med livsforsikrings- og SLT-sygeforsikringsforpligtelser, forventet hvert år fra år 1 til år 30, aggregeret for intervallet år 31-40, aggregeret for intervallet år 41-50 og aggregeret for alle år efter år 50. De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko. |

S.14.01 — Analyse af livsforsikringsforpligtelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indeholder oplysninger om livsforsikringsaftaler, kun ved direkte forsikringsvirksomhed, og omfatter også livsforsikringsforpligtelser fra skadesforsikringsaftaler, som f.eks. annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler (som også analyseres i S.16.01). Der gives ingen oplysninger for accepteret genforsikringsvirksomhed. Alle forsikringsaftaler skal indberettes, selv om de er klassificeret som investeringsaftaler på regnskabsmæssig basis. I tilfælde af opsplittede produkter indberettes produktets forskellige dele i forskellige rækker ved hjælp af forskellige ID-koder.

Alle oplysninger indberettes efter produkt, inklusive tabellen vedrørende porteføljeprodukter. Indberetning under fondsnummer er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed. Indberetning af specifikke poster i forbindelse med fondsnummer kan defineres af den nationale tilsynsmyndighed.

| | POST | VEJLEDNING |
|------------|-----------------|--|
| Portefølje | | |
| C0010 | Produkt-ID-kode | Intern produkt-ID-kode, som selskabet anvender for produktet. Hvis en kode allerede er i brug eller er tildelt af den kompetente myndighed i tilsynsøjemed, så skal denne kode anvendes. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>ID-koden skal være konsistent over tid.</p> <p>I de tilfælde, hvor det samme produkt skal indberettes i mere end en række, skal indholdet af C0010 (og C0090) følge det specifikke mønster: $\{\{ID\text{-kode for produkt}\}\}/\{\{versionsnummer}\}$. For eksempel »AB222/+/3«.</p> |
| C0030 | Branche | <p>Branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>29 — Sygeforsikring</p> <p>30 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> <p>32 — Anden livsforsikring</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livsgenforsikring.</p> |
| C0040 | Antal aftaler ved årets udgang | <p>Antal aftaler knyttet til hvert indberettet produkt. Aftaler med mere end én forsikringstager tæller som kun én kontrakt.</p> <p>I tilfælde af inaktiv forsikringstager (præmie ikke betalt) indberettes aftalen alligevel, medmindre aftalen er annulleret. Da der i dette tilfælde ikke er betalt nogen præmie, medtages disse inaktive forsikringstagere med præmier lig nul.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler anvendes antallet af annuitetsforpligtelser.</p> <p>For produkter, der er opsplittet i mere end en række, indberet venligst antallet af aftaler i alle indberettede rækker.</p> |
| C0041 | Antal aftaler ved udgangen af året — heraf aftaler med en genkøbsoption | <p>Antal aftaler ved udgangen af året, som indeholder en genkøbsoption for forsikringstageren</p> <p>Aftaler, hvor forsikringstagere ikke har ret til at genkøbe deres police, men stadig kan overføre deres police til et andet forsikringssselskab, skal anføres i denne celle.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0050 | Antal nye aftaler i løbet af året. | <p>Antal nye aftaler udstedt i løbet af indberetningsåret (dette gælder for alle nye aftaler). I øvrigt anvendes den samme vejledning som for celle C0040.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler anvendes antallet af annuitetsforpligtelser.</p> <p>Aftaler anses for at være nye aftaler, hvis de indregnes i værdiansættelsen af de forsikringsmæssige hensættelser på et hvilket som helst tidspunkt i løbet af året i overensstemmelse med artikel 17 i den delegerede forordning. Nye aftaler omfatter derfor fornyede aftaler, som ikke før blev medtaget i den aftalemæssige begrænsning, såvel som salg af ny virksomhed.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0051 | Antal aftaler genkøbt i løbet af året. | <p>Antal aftaler, der blev genkøbt i løbet af indberetningsåret.</p> <p>Hvis en aftale kun delvis er genkøbt, eller har fået status af fuldt indbetalt, anses dette ikke for at være et genkøb med henblik på C0051, da aftalen stadig er i forretningsbøgerne.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0054 | Antal forsikrede ved årets udgang | <p>Antal forsikrede personer ved årets udgang for aftaler indberettet i C0040.</p> <p>Antallet af forsikrede bør svare til antallet af forsikringstagere for en aftale. Ved policer af kollektiv eller koncernmæssig karakter, hvor forsikringstager både er distributør og forsikringstager, skal antallet af forsikrede svare til antallet af forsikrede personer, der er med i den kollektive aftale/koncernaftalen.</p> |
| C0055 | Skattemæssig behandling af produkterne | <p>I dette felt angives oplysninger om den skattemæssige behandling af produkterne, herunder især når den skattemæssige behandling kan påvirke beslutninger om genkøb eller opsigelse. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Ved policeudløb/genkøb er der intet tab i forbindelse med skatter eller subsidier 2 — Ved policeudløb/genkøb mistes tidligere eller fremtidige skattefordele eller andre subsidier 3 — Andre skattemæssige tab, der ikke er dækket ved ovenstående 4 — Ikke relevant <p>Valgmulighed 1 omfatter tilfælde, hvor forsikringstager ville lide et tab i forbindelse med skatter eller subsidier, medmindre et lignende forsikringselskab er rede til at acceptere aftalen.</p> <p>Skattefordele, der vedrører fremtidige præmier, dvs. hvor præmier reducerer fremtidige indkomstskattebetalinger, er ikke relevante for ovennævnte klassifikation.</p> <p>Hvorvidt der for en specifik aftale inden for et produkt rent faktisk ville opstå et skattemæssigt tab på værdiansættelsesdatoen, kan afhænge af de enkelte kontraktmæssige parametre, som f.eks. varighed eller forsikringstagers alder. Med henblik på indberetning i C0210 kræves der dog ingen differentiering efter sådanne parametre. Kriteriet bør vælges, hvis et sådant skattemæssigt tab kan opstå for det pågældende produkts aftaler.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0080 | Land | <p>ISO 3166-1 alpha-2-landekoden eller liste over koder i henhold til følgende vejledning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode for det land, hvor aftalen blev indgået, for lande, som repræsenterer mere end 10 % af de forsikringsmæssige hensættelser eller tegnede præmier for et givent produkt. — For lande, der repræsenterer mindre end 10 % af de forsikringsmæssige hensættelser eller tegnede præmier for et givent produkt, indberettes en liste over ISO 3166-1 alpha-2-koder for de pågældende lande. |

Porteføljeprodukter

| | | |
|-------|-------------|--|
| C0020 | Fondsnummer | Gælder for produkter, der indgår i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret på nationalt plan, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter. |
|-------|-------------|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.08.01). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> <p>Fondsnummeret er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed.</p> |
| C0060 | Samlet værdi af tegnede præmier | <p>De samlede tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant.</p> |
| C0061 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet direkte af forsikringselskabet | <p>Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet direkte af forsikringselskabet.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant.</p> |
| C0062 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet via kreditinstitutter | <p>Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet via kreditinstitutter, der handler som forsikringsdistributører.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant.</p> |
| C0063 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — heraf tegnet via andre forsikringsdistributører | <p>Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet via forsikringsdistributører, som ikke er kreditinstitutter.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant.</p> |
| C0070 | Samlet værdi af udbetalte erstatninger i løbet af året | <p>De samlede udbetalte erstatninger, brutto, i løbet af året, herunder skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0071 | Samlet værdi af udbetalt provision i løbet af året | <p>Provisioner bør indeholde enhver form for monetær ydelse, der betales til en forsikringsdistributør af enhver anden person end kunden eller en tredjepart, der handler på kundens vegne, i tilknytning til forsikringsdistributionsaktiviteter. Mens provisioner generelt beregnes som en procentdel af den præmie, som kunden betaler for forsikringsdækning, gælder dette for enhver form for betaling til en forsikringsdistributør (dvs. oprindeligt betalt/modtaget baseret på indgåelsen af en forsikringsaftale eller betalt/modtaget på et tilbagevendende grundlag).</p> <p>Hvis denne celle ikke finder anvendelse, f.eks. på grund af annuiteter fra skadesforsikringsaftaler, udfyldes denne celle ikke.</p> |
| C0075 | Forventede fremtidige præmier | <p>Præmier i alt for alle aftaler, der er gældende på værdiansættelsesdatoen, der forventes fremover, som prognosticeret i beregningen af det bedste skøn. Prognosticerede fremtidige præmier bør være nutidsværdien (og afspejle den samlede mængde præmier for aftalens forventede løbetid).</p> <p>Præmierne bør kun indregnes i den aftalemæssige begrænsning.</p> <p>Da beregning af forsikringsmæssige hensættelser kun kræves for homogene risikogrupper, kan der anvendes approksimative størrelser til specifikationen af hensættelser efter produkt.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0077 | Forventede fremtidige provisioner | <p>Provisioner i alt for alle aftaler, der er gældende på værdiansættelsesdatoen, der forventes fremover, som prognosticeret i beregningen af det bedste skøn.</p> <p>Prognosticerede fremtidige provisioner bør være nutidsværdien (og afspejle den samlede mængde provisioner for aftalens forventede løbetid). For en definition af provisioner henvises til C0071.</p> <p>Provisionerne bør kun indregnes i den aftalemæssige begrænsning.</p> <p>Da beregning af forsikringsmæssige hensættelser kun kræves for homogene risikogrupper, kan der anvendes approksimative størrelser til specifikationen af hensættelser efter produkt.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0180 | Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser under et | <p>Beløbet for det bedste bruttoskøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et efter produkt.</p> <p>Da beregning af forsikringsmæssige hensættelser kun kræves for homogene risikogrupper, kan der anvendes approksimative størrelser til specifikationen af hensættelser efter produkt.</p> |
| C0190 | Risikosum | <p>Risikosum som defineret i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Da beregning af forsikringsmæssige hensættelser kun kræves for homogene risikogrupper, kan der anvendes approksimative størrelser til specifikationen af hensættelser efter produkt.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler udfyldes denne celle med et nul, medmindre annuiteterne har positiv risiko.</p> |
| C0200 | Genkøbsværdi | <p>Genkøbsværdi (hvis en sådan foreligger) som nævnt i artikel 185, stk. 3, litra f), i direktiv 2009/138/EF, med fradrag af skatter: det beløb, der skal betales til forsikringstageren, hvis aftalen opsiges før tid (dvs. før forsikringen kommer til udbetaling ved udløb, eller før forsikringsbegivenheden indtræffer, f.eks. dødsfald), med fradrag af afgifter og politelån; vedrører ikke aftaler uden optioner, da genkøbsværdi er en option.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0260 | Garanteret rente — Garanteret rente på årsbasis (i den gennemsnitlige varighed af garantien) | <p>Gennemsnitlig garanteret årlig rente over for forsikringstager i aftalens resterende løbetid, udtrykt som procentsats.</p> <p>Hvis der ikke implicit eller eksplicit er anført nogen garanteret rente i denne aftale, udfyldes denne celle ikke, hvis der implicit eller eksplicit er anført en garanteret rente, indberettes denne (f.eks. »0 %«).</p> <p>Gælder, hvis der eksplicit er anført en gennemsnitlig garanteret rente i aftalen, eller hvis der implicit er givet en alternativ finansiel garanti, f.eks. i form af et garanteret forsikret beløb, et garanteret afkast på præmier eller en garanteret annuitetsydelse.</p> <p>Hvis der ikke eksplicit er anført nogen garanteret rente i denne aftale, indberettes den implicitte (årlige) garanterede rente fra værdiansættelsesdatoen til det forventede udløb af garantien.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0261 | Garanteret rente — Årlig garanteret rentesats for indberetningsåret | <p>Årlig garanteret rentesats for forsikringstageren i aftalen for indberetningsåret, udtrykt som procentsats.</p> <p>Hvis der ikke implicit eller eksplicit er anført nogen garanteret rente i denne aftale, udfyldes denne celle ikke, hvis der implicit eller eksplicit er anført en garanteret rente, indberettes denne (f.eks. »0 %«).</p> <p>Gælder, hvis der eksplicit er anført en gennemsnitlig garanteret rente i aftalen, eller hvis der implicit er givet en alternativ finansiel garanti, f.eks. i form af et garanteret forsikret beløb eller et garanteret afkast på præmier.</p> <p>Hvis der ikke eksplicit er anført nogen garanteret rente i denne aftale, indberettes den implicitte (årlig) garanterede rente for indberetningsperioden.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |
| C0270 | Udtrædelsesbetingelser på indberetningsdatoen | <p>Klassificer venligst produktet i henhold til den følgende udtømmende liste vedrørende udtrædelsesbetingelser på indberetningsdatoen:</p> <p>1 — Genkøbsværdi, der svarer til det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på under en uge</p> <p>2 — Genkøbsværdi, der svarer til det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på over en uge, men under tre måneder</p> <p>3 — Genkøbsværdi, der svarer til det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på over tre måneder</p> <p>4 — Genkøbsværdi på mellem 100 % (udelukkende) og 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på under en uge</p> <p>5 — Genkøbsværdi på mellem 100 % (udelukkende) og 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på over en uge, men under tre måneder</p> <p>6 — Genkøbsværdi på mellem 100 % (udelukkende) og 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på over tre måneder</p> <p>7 — Genkøbsværdi på under 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på under en uge</p> <p>8 — Genkøbsværdi på under 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og meddelelsesfrist på over en uge, men under tre måneder</p> <p>9 — Genkøbsværdi på under 80 % af det bedste skøn//lokale lovpligtige reserver og påkrævet varsel på over tre måneder</p> <p>10 — Andet</p> <p>Varslingsperioden skal forstås som den tidsperiode (f.eks. dage eller uger), som forsikringsselskabet kræver mellem forsikringstagers meddelelse om, at denne har til hensigt at opsige forsikringspolice og den faktiske dato for aftalens ophør. Dette udtryk henviser ikke til den karenperiode, i hvilken en kunde har ret til at opsige policen uden sanktioner.</p> <p>Hvis denne celle ikke finder anvendelse, f.eks. hvis en aftale ikke kan genkøbes på grund af annuiteter fra skadesforsikringsaftaler, udfyldes denne celle ikke.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0280 | Beløb, for hvilke der er garanteret rente | Monetære beløb, hvorpå den garanterede rente som indberettet i C0260 skal anvendes. Beløb skal indberettes som den monetære værdi pr. referencedatoen. Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler |

Produktets karakteristika

| | | |
|-------|-----------------------|--|
| C0101 | Produktklassifikation | Følgende udtømmende liste anvendes: 1. enkelt liv 2. fælles liv 3. kollektiv 4. andet Hvis mere end ét kendetegn er relevant, anvendes »4 — andet«. For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler anvendes »4 — andet«. |
| C0102 | Pensionsrettigheder | Angiv, hvis produktkategorien er pensionsrettigheder Følgende udtømmende liste anvendes: 1. Ja 2. Nej Ved vurderingen af, om et produkt skal klassificeres som pensionsrettigheder i skema S.14, overvejes følgende: — Om produktet er et pensionsprodukt baseret på en national forskrift/lov. Hertil kan »Databasen over pensionsplaner og -produkter i EØS«, der er offentliggjort på EIOPA's hjemmeside, tages i betragtning (med de undtagelser, der er omhandlet på hjemmesiden). — Om et produkt (dvs. et unit-linked produkt) akkumulerer penge til pension ved anvendelse af en skattefordel i tilknytning til pensioner. — Om de fremtidige betalinger udtrykkeligt er knyttet til selve pensioneringen. — Hvis produktet opfylder alle identificerede karakteristika, men også inkluderer en række meget usædvanlige situationer, hvor pengene kan videregives lige som langtidsledighed eller alvorlig sygdom, skal det fortsat anses for at være pensionsrettigheder. Følgende bør ikke påvirke beslutningen: — Hvis produktet erstatter eller er et supplement til det eksisterende sociale sikkerhedssystem. — Hvis produktet er obligatorisk (normalt tilfældet, hvis det er en erstatning) eller ikke obligatorisk (normalt tilfældet, hvis det er et supplement). — Hvis den fremtidige betaling skal ske i form af annuiteter eller gennem et engangsbeløb, så længe som betalingen sker på tidspunktet for pensioneringen |
| C0110 | Produkttype | Generel kvalitativ beskrivelse af produkttypen. Hvis en kode er tildelt af den kompetente myndighed i tilsynsøjemed, anvendes beskrivelsen af produkttypen for den pågældende kode. |
| C0120 | Produktbetegnelse | Produktets kommercielle navn (selskabsspecifik). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------|---|
| C0130 | Markedsføres produktet stadig? | <p>Angiv, om produktet stadig er til salg, eller om det er under afvikling. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Markedsføres stadig</p> <p>2 — Er under afvikling</p> |
| C0141 | Udbyttedeling | <p>Angiv, om produktkategorien omfatter udbyttedeling. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — Nej</p> |
| C0142 | Kontraktlig restløbetid | <p>Dette felt skal angive oplysninger om den gennemsnitlige kontraktlige restløbetid for aftalerne alt efter den pågældende produktkategori. Der skal vælges ud fra de følgende seks valgmuligheder:</p> <p>1 — < 5 år</p> <p>2 - 5-10 år</p> <p>3 - 10-15 år</p> <p>4 - 15-20 år</p> <p>5 - > 20 år</p> <p>6 - Livsvarig</p> <p>Fastlæggelsen baseres på antagelserne om, at aftalen ikke slutter som følge af en biometrisk risiko, forsikringstager udøver ikke en genkøbs- eller opsigelsesoption og foretager alle fornyelser, og forsikrings- og genforsikrings-selskabet udøver ikke nogen option med hensyn til at opsiges aftalen og foretager alle fornyelser. I tilfælde af en livsforsikring med udbetaling (endowment policy) ville dette f.eks. betyde, at den forsikrede person ikke dør, og at forsikringstager ikke opsiger aftalen. Med henblik på fastlæggelsen antages en typisk alder for en forsikringstager, når denne indgår aftalen.</p> <p>Tag eksemplet med en livsforsikring med udbetaling (endowment policy) med mulighed for opsigelse på ethvert tidspunkt, og hvor den typiske aftale indgås i en alder af 30 år og slutter med et engangsbeløb ved 65 år, hvis den forsikrede stadig er i live. Selv om aftalen kan slutte tidligere som følge af død eller opsigelse, skal optionen »> 20 år« vælges.</p> <p>Ikke relevant for annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler</p> |

S.14.02 — Analyse af skadesforsikringsforpligtelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indeholder oplysninger om skadesforsikringsaftaler, kun ved direkte forsikringsvirksomhed. Der skal ikke indgives oplysninger for accepteret genforsikringsvirksomhed.

Kolonne C0010 til C0120 indberettes efter branche med de undtagelser, der er angivet nedenfor, med muligheden for en yderligere opsplnitning efter produktkategori, som defineret i C0020.

| | POST | VEJLEDNING |
|------------|-----------------------|---|
| Portefølje | | |
| C0010 | Branche (1 til 12) | <p>Branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Oplysninger om produkter skal ikke opsplittes, men indberettes under hovedbranchen, medmindre andet er angivet i C0020. Alle markedsførte skadesforsikringsprodukter skal indberettes under den branche, der mest svarer til de vigtigste produkttegenskaber under hensyntagen til de produkttegenskaber og vigtigste risici, som produktet omfatter. For modulopbyggede produkter skal disse opsplittes, og der skal indberettes oplysninger for hvert enkelt produkt i pakken under den branche, der mest svarer til de vigtigste produkttegenskaber.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab |
| C0020 | Heraf produktkategori | <p>For skadesforsikringsprodukter, der tilhører en af de produktkategorier i den udtømmende liste ovenfor, indberettes der oplysninger i en separat række:</p> <p>7.1 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom, herunder naturkatastroferisici Produkter, der dækker skader på ejendomme og personer som følge af naturkatastrofer, herunder jordskælv, storm, hagl, frost og tørke.</p> <p>11.1 Assistance, herunder rejseforsikring: Produkter, der dækker uforudsete tab, der er opstået under rejser, som f.eks. dækning af afbestilling, bortkommen bagage, flyforsinkelser og/eller lægeudgifter under rejser.</p> <p>12.1 Diverse økonomiske tab, herunder afbrydelse af forretningsvirksomhed: Produkter, der omfatter afbrydelse af forretningsvirksomhed, lukning af virksomhed eller ethvert økonomisk tab af en sådan art, uanset om der kræves en fysisk skade på en forsikret ejendom (f.eks. afbrydelse af forretningsvirksomhed i relation til dækning af beskadiget ejendom som følge af storm eller oversvømmelse, lukning af virksomhed, der omfatter skade på grund af midlertidig lukning af forretninger som følge af administrative tiltag eller sundhedsmyndigheders beslutninger)</p> <p>12.2 Diverse økonomiske tab, herunder betalingsbeskyttelsesforsikring: Produkter, der omfatter den situation, hvor man ikke er i stand til at opfylde de finansielle forpligtelser ved et realkreditlån, et lån eller en anden kreditfacilitet, uanset årsag med undtagelse af dødsfald.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0030 | For produkter, der er markedsført under denne produktkategori/branche, hvilken andel heraf omfatter klimarelaterede risici (målt ved tegnede bruttopræmier)? (0-100) | Klimarelaterede risici omfatter hændelser som f.eks. oversvømmelser, hedeølger, jordskred, tørke eller naturbrande. Tag i betragtning, at der under en branche kan være flere produkter, hvor nogle dækker klimarelaterede risici og andre ikke, og indberet venligst den procentsats af produkter i denne kategori (målt ved tegnede bruttopræmier), som dækker mindst et aspekt af klimarelaterede risici, mellem 0 og 100. |
| C0040 | Hvis produktet dækker klimarelaterede risici, giver produktets udformning mulighed for risiciforebyggelse? (Ja/Nej/Ikke relevant) | Hvis denne branche indeholder mindst et produkt, der omfatter mindst et aspekt af de klimarelaterede risici, angiv venligst med »Ja« eller »Nej«, hvis nogle af disse produkter omfatter risiciforebyggelse i deres udformning. Forebyggelse i denne sammenhæng henviser til forhold som finansielle incitamenter for forsikringstager til at reducere den underliggende forsikringsrisiko (f.eks. gennem afslag på præmier eller lavere fradrag) eller en skræddersyet risikoevner fra forsikringselskabet med henblik på at rådgive forsikringstager om de til rådighed stående foranstaltninger til indførelse af risikoreduktion. |
| C0050 | Antal aftaler ved årets udgang | Antal aftaler til hvert produkt, der hører ind under den relevante branche. Aftaler med mere end én forsikringstager tæller som kun én kontrakt. I tilfælde af inaktive forsikringstagere (præmie ikke betalt) indberettes aftalen alligevel, medmindre aftalen er annulleret. |
| C0060 | Antal nye aftaler i løbet af året. | Antal nye aftaler i løbet af indberetningsåret (dette gælder for alle nye aftaler, også fornyede). Ny aftale henviser til aftaler, der er indgået i løbet af året med hensyn til andre igangværende aftaler, der er indgået i de foregående år. Aftaler med mere end én forsikringstager tæller som kun én kontrakt. I tilfælde af inaktive forsikringstagere (præmie ikke betalt) indberettes aftalen alligevel, medmindre aftalen er annulleret. |
| C0070 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet direkte af forsikringselskabet | Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet direkte af forsikringselskabet. |
| C0080 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet via kreditinstitutter | Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet via kreditinstitutter, der handler som forsikringsdistributører. |
| C0090 | Samlet beløb for tegnede bruttopræmier — tegnet via forsikringsdistributører, som ikke er kreditinstitutter | Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35, tegnet via forsikringsdistributører, som ikke er kreditinstitutter. |
| C0100 | Samlet værdi af udbetalt provision i løbet af året | Provisioner bør indeholde enhver form for monetær ydelse, der betales til en forsikringsdistributør af enhver anden person end kunden eller en tredjepart, der handler på kundens vegne, i tilknytning til forsikringsdistributionsaktiviteter. Mens provisioner generelt beregnes som en procentdel af den præmie, som kunden betaler for forsikringsdækning, gælder dette for enhver form for betaling til en forsikringsdistributør (dvs. oprindeligt betalt/modtaget baseret på indgåelsen af en forsikringsaftale eller betalt/modtaget på et tilbagevendende grundlag). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0110 | Samlet værdi af udbetalte erstatninger i løbet af året | Erstatninger udbetalt i løbet af året i forhold til summen af den direkte forsikringsvirksomhed. Det indeholder ikke ændringer i hensættelserne for erstatninger, som endnu ikke er betalt, og udelukker skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelserne til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0120 | Land | ISO 3166-1 alpha-2-landekoden eller liste over koder i henhold til følgende vejledning: — ISO 3166-1 alpha-2-kode for det land, hvor aftalen blev indgået, for lande, som repræsenterer mere end 10 % af de forsikringsmæssige hensættelser eller tegnede præmier for et givent produkt. — for lande, der repræsenterer mindre end 10 % af de forsikringsmæssige hensættelser eller tegnede præmier for et givent produkt, indberettes en liste over ISO 3166-1 alpha-2-koder for de pågældende lande. |

Oplysninger om antal forsikrede

| | | |
|-------|---|---|
| C0130 | Antal forsikrede ved årets udgang | For produkter, der henhører under branche 1 og produktkategorier 11.1 og 12.2 indberettes det samlede antal forsikrede for aftaler, der er indberettet under C0050. |
| C0140 | Antal forsikrede ejendomme ved årets udgang | For produkter, der henhører under branche 4 og 5 indberettes det samlede antal forsikrede ejendomme for aftaler, der er indberettet under C0050. |

S.14.03 — Forsikring mod cyberrisici

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringselskaber, der garanterer produkter, der dækker cyberrisici som defineret i disse vejledninger.

Selskaber skal angive oplysninger om forsikringer mod cyberrisici, efter produktgruppekode og efter produktidentifikation. Hvis der angives mere end et markedsført produkt for den samme produktidentifikation, for den samme gruppe af brancher og den samme gruppe af risikodækning, indberettes produkterne ved anvendelse af en enkelt linje med angivelse af en »produktgruppekode«, specificeret af selskabet med henblik på at identificere gruppen af indberettede produkter. Produkter med den samme produktidentifikation, som ikke deler de nævnte egenskaber, kan ikke samles og skal derfor indberettes på separate linjer.

Når der er behov for en særlig begrundelse, skal forklaringen ikke afgives i indberetningskemaet, men indgå i dialogen mellem selskaberne og de nationale kompetente myndigheder.

I dette skema anvendes der en tærskel, der er baseret på følgende:

- Summen af præmieindtægter for enkeltstående cyberrisikopolicer og policer med tillæg af cyberrisikodækning (hvor kun de (skønnede) præmieindtægter for cyberrisici skal tages i betragtning) er større end 5 % af selskabets samlede skadesforsikringsvirksomhed eller over 5 mio. EUR.

ELLER

- Antallet af policer, der omfatter cyberrisikodækning (dvs. enkeltstående cyberrisikopolicer og/eller med tillæg af cyberrisikodækning) tegner sig for mere end 3 % af det samlede antal skadesforsikringspolicer).

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|---|
| C0010 | Produktgruppekode | Intern ID-kode for produktgrupper, specificeret af selskabet. Koden for produktgruppe skal være konsistent over tid. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | I de tilfælde, hvor det samme produkt skal indberettes i mere end en række, skal indholdet af C0010 følge det specifikke mønster: {{Produktgruppekode}}/+/{{kardinaltal}}. For eksempel »AB222/+1«. |
| C0020 | Målmarked | <p>Identifikation af målmarked En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 - B2B (Business to Business) 2 - Privat 3 - Begge <p>I kraft af detaljeringsgraden for risici angivet i celle C0060 forventes valgmulighed 3 kun at være for særlig tilfælde af den regelmæssige identifikation af målmarked for produktkategorier.</p> |
| C0030 | Produktidentifikation | <p>Identifikation af produktkategori. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) Tab for første part (2) Tab for tredje part (3) Omkostninger og tilhørende tjenester <p>Tab for første part omfatter tab, der vedrører forsikringstagers egne data eller tab af indkomst, herunder enhver negativ konsekvens, der som følge af en hændelse kan medføre brud på datasikkerheden eller cyberangreb på forsikringstagers virksomhed eller personlige sfære</p> <p>Tab for tredje part omfatter tab, der vedrører forsikringstagers ansvar for skader vedrørende andres data eller tab af indkomst, herunder enhver negativ konsekvens, der som følge af en hændelse kan medføre brud på datasikkerheden eller cyberangreb på forsikringstagers virksomhed eller personlige sfære.</p> <p>Omkostninger og tilhørende tjenester omfatter dækning, der kun vedrører omkostninger eller tjenester, der ydes af udstederen af forsikringsdækningen med henblik på at genoprette systemer og data efter et cyberangreb (inklusive juridiske omkostninger).</p> <p>Der kan i princippet kun vælges et element i listen for at angive produktidentifikation, men i særlige tilfælde og ved indberetning fra genforsikringselskaber er indberetning af flere valgmuligheder tilladt.</p> <p>Produktidentifikationen sker udelukkende ved kombinationen af branche(r) og risikobeskrivelsen i dækningen, forudsat at sidstnævnte ikke er udfyldt som »Andet«, eller at der er angivet flere valgmuligheder på listen. Hvis det er tilfældet, kan to produktkategorier, der er karakteriseret ved samme branche(r) og risikobeskrivelsen i dækningen angivet som »Andet«, ikke anses for at være den samme produktidentifikation og skal indberettes ved separate linjer.</p> |
| C0040 | Dækning af cyberrisici i produktidentifikation | <p>Identifikation af cyberrisikodækning i de markedsførte produkter, der er omfattet af produktidentifikationen En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) Enkeltstående cyberrisikodækning (2) Cyberrisici som tillæg, men den væsentligste risiko er dækket (3) Cyberrisici som tillæg, men den væsentligste risiko er ikke dækket |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------|--|
| | | <p>Enkelstående cyberrisikodækning omfatter al form for dækning, hvor cyberrisikodækning ydes som enkelstående dækning (dvs. udelukkende).</p> <p>Cyberrisici som tillæg, men den væsentligste risiko (> 50 %) er dækket og omfatter al form for dækning, hvor cyberrisici er et tillæg, men udgør den væsentligste afdækkede risiko.</p> <p>Cyberrisici som tillæg, men den væsentligste risiko (< 50 %) er ikke dækket og omfatter al form for dækning, hvor cyberrisici er et tillæg, men udgør ikke den væsentligste afdækkede risiko.</p> <p>Der kan kun vælges et element i listen for at angive produktidentifikation.</p> |
| C0050 | Branche(r) | <p>Identifikation af brancher, der er omfattet af de markedsførte produkter. Valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring — udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring — indkomstsikring 15 — Proportional genforsikring — arbejdsskadeforsikring 16 — Proportional genforsikring — motoransvarsforsikring 17 — Proportional genforsikring — anden motorforsikring 18 — Proportional genforsikring — sø-, luftfarts- og transportforsikring 19 — Proportional genforsikring — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional genforsikring — almindelig ansvarsforsikring 21 — Proportional genforsikring — kredit- og kautionsforsikring 22 — Proportional genforsikring — retshjælpsforsikring 23 — Proportional genforsikring — assistance 24 — Proportional genforsikring — Diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional genforsikring — sygeforsikring 26 — Ikkeproportional genforsikring — ulykkesforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>27 — Ikkeproportional genforsikring — ulykkesforsikring</p> <p>28 — Ikkeproportional genforsikring — ejendom.</p> |
| C0060 | Beskrivelse af risiko/risici i dækningen | <p>Beskrivelse af de risici, der er omfattet i dækningen ved anvendelse af valgmulighederne i følgende udtømmende liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Netværksafbrydelse (henviser til en netværkssikkerhedsfejl, der fører til en afbrydelse af forretningsvirksomhed) Eksempler kan omfatte et DDoS-angreb (Distributed Denial of Service) (dvs. en hjemmeside, der overbebyrdes med forespørgsler udført af en ondsindet part), eller en hacker, der får adgang til netværket og sletter kritiske filer eller tilføjer skadelige koder, der får systemet til at gå ned). 2) Netværksafbrydelse OSP (Outsourced Service Providers), dvs. en klient/server-protokol, der styrer adgangskontrol, bogføring, brugsdata og interdomænerouting for at gøre det lettere for internetudbydere at understøtte internettelefoner) 3) Netværksafbrydelse: systemnedbrud, der kan omfatte en »utilsigtet eller ikke planlagt afbrydelse« på netværket. Nedbruddet kan skyldes menneskelige fejl, systemfejl eller begge. (f.eks. kan en virksomhed, der opgraderer sit bogføringssystem mod forventning få hele netværket til at blokere under processen) 4) Cyberafpresning (en form for online-kriminalitet, hvor en hjemmeside, e-mail-server eller et computersystem underkastes gentagne DDoS-angreb eller andre angreb af ondsindede hackere, som forlanger penge til gengæld for at stoppe angrebene) 5) Hændelser vedrørende elektroniske data (hændelse, hvor følsomme, fortrolige eller på anden måde beskyttede data tilgås og/eller oplyses på uautoriseret vis). Databrud kan vedrøre personlige sundhedsoplysninger, personligt identificerbare oplysninger, handelshemmeligheder eller intellektuel ejendom) 6) Cybertyveri (kan omfatte online-bedrageri eller andre ulovlige aktiviteter) 7) Gendannelse af data (henviser til processen med at kopiere backupdata fra en sekundær lagringsfacilitet og gendanne disse på det oprindelige sted eller et nyt sted. Gendannelse udføres, for at data, der er gået tabt, blevet stjålet eller beskadiget, vender tilbage til sin oprindelige form eller flyttes til et nyt sted) 8) Ekstra omkostning 9) Omkostninger ved systemoprydning 10) Administrativ undersøgelse og sanktioner 11) Fysisk skade 12) Databeskyttelse og cyberansvar (omfatter også implikationer fra databeskyttelsesforordningen over for databeskyttelse af tredje part) 13) Medieansvar (f.eks. omdømmemæssig risiko) 14) Ulovlige indsamling af oplysninger 15) Overtrædelse af medieindhold/ærekkrænkende indhold 16) Overtrædelse af forpligtelser med hensyn til meddelelse (meddelelse af databrud er fastlagt i specificerede tidsintervaller i henhold til bestemmelser i lovgivning eller databeskyttelsesforordningen) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | 17) Første reaktion (omkostninger ved hurtig reaktion som svar på angreb for at genoprette tjenesten) 18) Håndtering af hændelser (alle aktiviteter, der er nødvendige for at genoprette normal aktivitet) 19) Kommunikationsomkostninger (databrud i forbindelse med big data kan nødvendiggøre massekommunikation af resultaterne af databruddet) 20) Overvågningsaktivitet i relation til kredit/identitet (sikre at data, der er indsamlet hos kunder eller ansatte osv. vedrørende kreditter og identitet gendannes eller blokeres) 21) Bidrag til fond til bekæmpelse af kriminalitet (bidrag til statslig fond, der er etableret til dækning af cyberansvar over for tredjeparter) 22) Relateret afbrydelse af forretningsvirksomhed 23) Økonomisk bedrageri 24) Andet Der kan indberettes mere end en valgmulighed. |
| C0070 | Beskrivelse af andre risici | En detaljeret beskrivelse af risici, hvis der er valgt andre risici. |
| C0080 | Forsikringssum | Den samlede forsikringssum for den indberettede produktidentifikation. |
| C0090 | Præmie(r) | De(n) samlede præmieindtægt(er) for den indberettede produktidentifikation. |
| C0100 | Genforsikringssum | Det samlede beløb, der er cederet til genforsikringselskaber for den indberettede produktidentifikation. |
| C0110 | Antal krav, der er afregnet med betaling | Antal krav for den relevante produktkategori, der er afregnet med betaling i indberetningsåret. |
| C0120 | Beløb for udbetalte erstatninger | Beløb for udbetalte erstatninger for den relevante produktidentifikation, som er afregnet med betaling i indberetningsåret. |
| C0130 | Antal krav, der er afregnet uden betaling | Antal krav for den relevante produktidentifikation, der er afregnet uden betaling i indberetningsåret. |
| C0140 | Forsikringsmæssige hensættelser | Beløbet for de forsikringsmæssige hensættelser for den relevante produktidentifikation. |

S.16.01 — Oplysninger om annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsvirksomhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema indberettes ikke for accepteret genforsikringsvirksomhed.

Dette skema skal kun indberettes for formelt afregnede annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og i tilknytning til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser.

Formelt afviklet som en annuitet betyder, at det ved en retslig procedure er afgjort, at den begunstige skal modtage betalinger som en annuitet.

Hvis det, efter at en forpligtelse er blevet formelt afviklet som en annuitet, viser sig, at en del af forpligtelsen efterfølgende ender med at blive afviklet via et engangsbeløb, som ikke var inkluderet i den oprindelige afgørelse om annuitetsbetalinger, skal dette engangsbeløb registreres som en betaling i skema S.16.01; dvs. at der ikke skal flyttes data om krav fra skema S.16.01 til S.19.01.

Selskaberne skal indberette oplysningerne på ulykkesår- eller forsikringsårsbasis i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskabet anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

Dette skema skal indberettes for hver skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, hvorfra annuiteten hidrører, og efter valuta, idet der tages hensyn til følgende specifikationer:

- i. Hvis det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav på diskonteret grundlag fra en skadesforsikringsbranche udgør mere end 3 % af det samlede bedste skøn over alle hensættelser til annuitetskrav, skal oplysningerne indberettes med følgende opdeling efter valuta ud over det samlede beløb for branchen:
 - a) beløb for indberetningsvalutaen
 - b) beløb for alle valutaer, der udgør mere end 25 % af det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav på diskonteret grundlag fra den pågældende skadesforsikringsbranche, eller
 - c) beløb for alle valutaer, der udgør mindre end 25 % af det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav (diskonteret grundlag) fra den pågældende skadesforsikringsbranche, men mere end 5 % af det samlede bedste skøn over alle hensættelser til annuitetskrav.
- ii. Hvis det bedste skøn over hensættelserne til annuitetskrav på diskonteret grundlag fra en skadesforsikringsbranche udgør mindre end 3 % af det samlede bedste skøn over alle hensættelser til annuitetskrav, kræves der ikke opdeling efter valuta, kun det samlede beløb for branchen skal indberettes.
- iii. Oplysningerne skal indberettes i den oprindelige valuta for aftalerne, medmindre andet er angivet.
- iv. For captive-forsikrings- og -genforsikrings-selskaber, der opfylder betingelserne i artikel 4, stk. 4 og 5, indberettes dette skema uden valutaopdeling, dvs. i Z0030 indberettes altid det samlede beløb.

Som allerede anført ovenfor hænger dette skema sammen med skemaet for skadesforsikring S.19.01. Summen af forsikringsmæssige hensættelser i skema S.16.01 og S.19.01 for en skadesforsikringsvirksomhed, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udgør det samlede bedste skøn over krav hidrørende fra denne branche (jf. også skema S.19.01). Hele eller dele af en forpligtelse flyttes fra S.19.01 til S.16.01, når nedennævnte betingelser begge er opfyldt:

- i. Hele eller dele af forpligtelsen er formelt afviklet som en annuitet, og
- ii. der kan fastsættes et bedste skøn over en forpligtelse, der formelt er afviklet som en annuitet, ved hjælp af livsforsikringsmetoder.

År N er indberetningsåret.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| Z0010 | Den tilknyttede skadesforsikringsbranche | <p>Navnet på branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Forpligtelsens oprindelse (udgifter til lægebehandling, indkomstsikring, arbejdsskade, motoransvar osv.). Alle tal i skemaet hidrører fra den tilknyttede branche.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — 1 og 13 Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>2 — 2 og 14 Indkomstsikring</p> <p>3 — 3 og 15 Arbejdsskadeforsikring</p> <p>4 — 4 og 16 Motoransvarsforsikring</p> <p>5 — 5 og 17 Anden motorforsikring</p> <p>6 — 6 og 18 Sø-, luftfarts- og transportforsikring</p> <p>7 — 7 og 19 Forsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>8 — 8 og 20 Almindelig ansvarsforsikring</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------|---|--|
| | | 9 — 9 og 21 Kredit- og kautionsforsikring 10 — 10 og 22 Retshjælpsforsikring 11 — 11 og 23 Assistance 12 — 12 og 24 Diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring 28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring |
| Z0020 | Ulykkesår/forsikringsår | Angiv, hvilken standard selskabet anvender ved indberetning af udviklingen i krav. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ulykkesår 2 — Forsikringsår. |
| Z0030 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for forpligtelsens afviklingsvaluta. Alle beløb, der ikke er indberettet efter valuta, indberettes i selskabets indberetningsvaluta. Denne post skal udfyldes med »I alt« ved indberetning af det samlede beløb for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. For captive-forsikrings- og -genforsikringsselskaber, der opfylder betingelserne i artikel 4, stk. 4 og 5, indberettes altid det samlede beløb i denne celle. |
| Z0040 | Valutaomregning | Angiv, om de oplysninger, der indberettes efter valuta, indberettes i den oprindelige valuta (standard) eller i indberetningsvalutaen (angives i så fald). Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Oprindelig valuta 2 — Indberetningsvaluta Kun relevant, hvis der indberettes efter valuta. |
| Oplysninger om år N: | | |
| C0010/R0010 | Gennemsnitlig rentesats | Den anvendte gennemsnitlige rentesats i procent (som decimaltal) ved udgangen af år N |
| C0010/R0020 | Forpligtelsernes gennemsnitlige varighed. | Gennemsnitlig varighed i år på grundlag af de samlede forpligtelser ved udgangen af år N. |
| C0010/R0030 | De begunstigedes vægtede gennemsnitlige alder | Vægtningen skal være det bedste skøn over hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N. De begunstigedes alder beregnet ved anvendelse af et vægtet gennemsnit for de samlede forpligtelser. Den begunstigede er den person, som betalingerne vender tilbage til, som følge af et krav (som påvirker den forsikrede), der ligger til grund for denne type betaling. Oplysningerne bør tages i betragtning uden fradrag af genforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | Oplysninger om annuiteter: | |
| C0020/R0040–R0190 | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved begyndelsen af år N | Bedste skøn over annuitetskrav hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser ved begyndelsen af år N. |
| C0030/R0040–R0190 | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav foretaget i løbet af år N | Samlet værdi af hensættelser til annuitetskrav hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser foretaget i løbet af år N, fra det tidspunkt, de første gang blev foretaget (dvs. hvor de anvendte antagelser for første gang var baseret på livsforsikringsmetoder) Dette er en del af de forsikringsmæssige hensættelser foretaget i løbet af år N (nettobevægelser mellem nye reserver i løbet af år N/frigivelse af reserver i løbet af år N) |
| C0040/R0040–R0190 | Annuitetsbetalinger betalt i løbet af år N | Samlet værdi af annuitetsbetalinger hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser foretaget i løbet kalenderåret N. |
| C0050/R0040–R0190 | Udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N | Samlet værdi af hensættelser til annuitetskrav hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser ved udgangen af år N. |
| C0060/R0040–R0190 | Antal annuitetsforpligtelser ved udgangen af år N | Antal annuitetsforpligtelser vedrørende skadesforsikring. |
| C0070/R0040–R0190 | Det bedste skøn over hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N (diskonteret grundlag) | Det bedste skøn omfattende annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser ved udgangen af kalenderår N. Oplysningerne bør tages i betragtning uden fradrag af genforsikring. |
| C0080/R0040–R0190 | Udiskonterede udviklingsresultater | Udiskonterede udviklingsresultater beregnet som udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved begyndelsen af år N minus annuitetsbetalinger betalt i løbet af år N og minus udiskonterede hensættelser til annuitetskrav ved udgangen af år N. |
| C0020–C0080/R0200 | I alt | Samlet værdi af udiskonterede udviklingsresultater for alle ulykkesår/forsikringsår. |

S.17.01 — Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Selskaber kan anvende relevante approksimative størrelser til beregning af forsikringsmæssige hensættelser som omhandlet i artikel 21 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Endvidere kan artikel 59 i delegeret forordning (EU) 2015/35 anvendes til at beregne risikomarginen i løbet af regnskabsåret.

Branche for skadesforsikringsforpligtelser: De brancher, som er omhandlet i artikel 80 i direktiv 2009/138/EF og defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og som vedrører direkte forsikringsvirksomhed/accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring. Segmenteringen skal afspejle arten af kontraktens underliggende risici (substans) og ikke kontraktens juridiske form (form).

Direkte sygeforsikringsvirksomhed, der udøves på et forsikringsmæssigt grundlag, der svarer til livsforsikring, skal segmenteres i branchen skadesforsikring 1-3.

Accepteret proportional genforsikring skal betragtes sammen med direkte forsikringsvirksomhed i C0020-C0130.

De oplysninger, der skal indberettes mellem R0010 og R0280, skal være efter volatilitetsjustering, matchtilpasning og overgangsjustering på den relevante risikofrie rentekurve, hvis den anvendes, men må ikke omfatte overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser kræves indberettet separat mellem række R0290 og R0310.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fonde, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| | <i>Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et</i> | |
| C0020-C0170/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret forsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0180/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — samlede skadesforsikringsforpligtelser | De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et vedrørende direkte og accepteret forsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0020-C0130/R0020 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — direkte forsikringsvirksomhed | Værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0180/R0020 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, direkte forsikringsvirksomhed i alt | De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, for direkte forsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0020-C0130/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — accepteret proportional genforsikringsvirksomhed | Værdi af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0180/R0030 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed i alt | De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0140-C0170/R0040 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et — accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| C0180/R0040 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed i alt | De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. Dette beløb skal være uden fradrag af eventuelle beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance i tilknytning til denne virksomhed. |
| C0020-C0170/R0050 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0050 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse i forbindelse med forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. | Samlet beløb, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse af forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche |
| <i>Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af et bedste skøn og en risikomargin — det bedste skøn</i> | | |
| C0020-C0170/R0060 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto, i alt | Beløbet for det bedste skøn over præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret virksomhed. |
| C0180/R0060 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto, i alt | Det samlede bedste skøn over præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, vedrørende direkte og accepteret virksomhed. |
| C0020-C0130/R0070 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto — direkte forsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over præmiehensættelser, for direkte forsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0070 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto, direkte forsikringsvirksomhed i alt | Det samlede bedste skøn over præmiehensættelser, for direkte forsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0020-C0130/R0080 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto — accepteret proportional genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over præmiehensættelser, for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0180/R0080 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed i alt | Det samlede bedste skøn over præmiehensættelser, for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0140-C0170/R0090 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto — accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over præmiehensættelser, for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0090 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, brutto, accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, i alt | Det samlede bedste skøn over præmiehensættelser, for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0020-C0170/R0100 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0100 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/R0110 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab — direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0110 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0170/ R0120 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0120 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold fra SPV'er før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/ R0130 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves fra finite reinsurance før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0130 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/ R0140 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, for hver branche, som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0140 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over præmiehensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/ R0150 | Det bedste nettoskøn over præmiehensættelser — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste nettoskøn, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0150 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste nettoskøn over præmiehensættelser | Det samlede bedste nettoskøn over præmiehensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0170/ R0160 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, i alt | Værdi af det bedste skøn over erstatningshensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret virksomhed. |
| C0180/R0160 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, i alt | Det samlede bedste skøn over erstatningshensættelser, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0020-C0130/ R0170 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto — direkte forsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over erstatningshensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0170 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, direkte forsikringsvirksomhed i alt | Det samlede bedste skøn over erstatningshensættelser, direkte forsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0020-C0130/ R0180 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto — accepteret proportional genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over erstatningshensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende accepteret proportional genforsikring. |
| C0180/R0180 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed i alt | Det samlede bedste skøn over erstatningshensættelser, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0140-C0170/ R0190 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto — accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste skøn over erstatningshensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende accepteret ikkeproportional genforsikring. |
| C0180/R0190 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed | Det samlede bedste skøn over erstatningshensættelser, uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, fra SPV'er og finite reinsurance. |
| C0020-C0170/ R0200 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0180/R0200 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/R0210 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0210 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, Det bedste skøn over erstatningshensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (undtagen SPV'er og finite reinsurance) før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/R0220 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0220 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/R0230 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves fra finite reinsurance før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0230 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til finite reinsurance før justeringen for forventede tab, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0020-C0170/ R0240 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, for hver branche, som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0240 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste skøn over erstatningshensættelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, og som vedrører det bedste skøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/ R0250 | Det bedste nettoskøn over erstatningshensættelser — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Værdi af det bedste nettoskøn over erstatningshensættelser, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0250 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det bedste nettoskøn over erstatningshensættelser | Det samlede bedste nettoskøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/ R0260 | Samlet bedste bruttoskøn — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Værdi af det samlede bedste bruttoskøn, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0260 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det samlede bedste bruttoskøn | Det samlede bedste bruttoskøn (summen af præmiehensættelser og erstatningshensættelser) |
| C0020-C0170/ R0270 | Det bedste nettoskøn — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Værdi af det samlede bedste nettoskøn, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0270 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, det samlede bedste nettoskøn | Det samlede bedste nettoskøn (summen af præmiehensættelser og erstatningshensættelser) |
| C0020-C0170/ R0280 | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet som summen af et bedste skøn og en risikomargin — risikomargin | Beløbet for risikomargin som krævet i henhold til direktiv 2009/138/EF (artikel 77, stk. 3). Risikomarginen beregnes under et for hele porteføljen af (gen)forsikringsforpligtelser og allokeres derefter til hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0280 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, samlet risikomargin | Den samlede risikomargin som krævet i henhold til direktiv 2009/138/EF (artikel 77, stk. 3). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | <i>Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser</i> | |
| C0020-C0170/R0290 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0180/R0290 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Det samlede fradrag, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0170/R0300 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — bedste skøn | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til det bedste skøn, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0180/R0300 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — bedste skøn | Det samlede overgangsfradrag, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til det bedste skøn. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0170/R0310 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — risikomargin | Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til risikomarginen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0180/R0310 | Beløbet for overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — risikomargin | Det samlede fradrag, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, i de forsikringsmæssige hensættelser allokere til risikomarginen. Denne værdi indberettes som en negativ værdi, når den mindsker de forsikringsmæssige hensættelser. |
| | <i>Forsikringsmæssige hensættelser — i alt</i> | |
| C0020-C0170/R0320 | Forsikringsmæssige hensættelser, i alt — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | De samlede forsikringsmæssige bruttohensættelser for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0180/R0320 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, forsikringsmæssige hensættelser — i alt | De samlede forsikringsmæssige bruttohensættelser vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| C0020-C0170/ R0330 | Forsikringsmæssige hensættelser, i alt — samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, for hver branche, som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0180/R0330 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | Det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftale/fra SPV'er og finite reinsurance efter justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed. |
| C0020-C0170/ R0340 | Forsikringsmæssige hensættelser, i alt — forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | De samlede forsikringsmæssige nettohensættelser for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0180/R0340 | Samlede skadesforsikringsforpligtelser, forsikringsmæssige hensættelser minus beløb, der kan tilbagekræves fra SPV'er — direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed | De samlede forsikringsmæssige nettohensættelser vedrørende direkte og accepteret genforsikringsvirksomhed, herunder forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et og efter overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. |
| <i>Branche: yderligere segmentering (homogene risikogrupper)</i> | | |
| C0020-C0170/ R0350 | Branche, yderligere segmentering efter (homogene risikogrupper) — præmiehensættelser — samlet antal homogene risikogrupper | Oplysninger vedrørende antallet af homogene risikogrupper i segmenteringen, hvis (gen)forsikringsselskabet har segmenteret branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, yderligere i homogene risikogrupper i henhold til arten af kontraktens underliggende risici, for hver branche, hvor den pågældende segmentering blev foretaget, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, for så vidt angår præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/ R0360 | Branche, yderligere segmentering efter (homogene risikogrupper) — erstatningshensættelser — samlet antal homogene risikogrupper | Oplysninger vedrørende antallet af homogene risikogrupper i segmenteringen, hvis (gen)forsikringsselskabet har segmenteret branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, yderligere i homogene risikogrupper i henhold til arten af kontraktens underliggende risici, for hver branche, hvor den pågældende segmentering blev foretaget, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, for så vidt angår erstatningshensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0020-C0170/ R0370 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstab, fremtidige ydelser og krav | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige ydelser og krav anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstab, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0370 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstab, fremtidige ydelser og krav — i alt | Det samlede cash flow for fremtidige ydelser og krav anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser. |
| C0020-C0170/ R0380 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige udgifter og andre likviditetstab anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstab, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0380 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab — i alt | De samlede fremtidige udgifter og andre likviditetstab anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser. |
| C0020-C0170/ R0390 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstilførsler, fremtidige præmier | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige præmier anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstilførsler, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0390 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstilførsler, fremtidige præmier — i alt | De samlede fremtidige præmier anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser. |
| C0020-C0170/ R0400 | Det bedste skøn over præmie-hensættelser, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for andre likviditetstilførsler, herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation, anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmie-hensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstilførsler, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0180/R0400 | Det bedste skøn over præmiehensættelser, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) — i alt | De samlede andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over præmiehensættelser. |
| C0020-C0170/R0410 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige ydelser og krav | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige ydelser og krav anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstab, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0410 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige ydelser og krav — i alt | De samlede erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige ydelser og krav anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/R0420 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige udgifter og andre likviditetstab anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstab, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0420 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab — i alt | De samlede erstatningshensættelser, likviditetstab, fremtidige udgifter og andre likviditetstab anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/R0430 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, fremtidige præmier | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af cash flow for fremtidige præmier anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstilførsler, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitssceneriet indberettes. |
| C0180/R0430 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, fremtidige præmier — i alt | De samlede erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, fremtidige præmier anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0020-C0170/ R0440 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) | Værdi af opdelingen, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikring og accepteret ikkeproportional genforsikring, af likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation), anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, dvs. det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige likviditetstilførsler, diskonteret for at tage hensyn til pengenes tidsværdi (forventet nutidsværdi af fremtidige cash flow). Hvis der anvendes en stokastisk metode for cash flow-fremskrivning, skal gennemsnitsscenarioet indberettes. |
| C0180/R0440 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) — i alt | De samlede erstatningshensættelser, likviditetstilførsler, andre likviditetstilførsler (herunder genindvundne beløb fra restværdi og subrogation) anvendt til at fastlægge det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser. |
| C0020-C0170/ R0450 | Anvendelse af forenklede metoder og teknikker til beregning af forsikringsmæssige hensættelser — procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser | Angiv procentdelen af det bedste bruttoskøn medtaget i samlede bedste skøn, brutto (R0260) beregnet ved hjælp af approksimative størrelser som fastsat i artikel 21 i delegeret forordning (EU) 2015/35, for hver branche. |
| C0180/R0450 | Anvendelse af forenklede metoder og teknikker til beregning af forsikringsmæssige hensættelser — procentdel af det bedste bruttoskøn beregnet ved hjælp af approksimative størrelser — i alt | Procentdelen af det samlede bedste bruttoskøn medtaget i samlede bedste skøn, brutto, (R0260) beregnet ved hjælp af approksimative størrelser som fastsat i artikel 21 i delegeret forordning (EU) 2015/35, for hver branche vedrørende direkte forsikringsvirksomhed og accepteret proportional genforsikringsvirksomhed og accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. |
| C0020-C0170/ R0460 | Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Angiv værdien af det bedste skøn indberettet under R0260 under hensyn til overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0460 | Det bedste skøn under hensyn til overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Samlede skadesforsikringsforpligtelser | Angiv den samlede værdi, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, af det bedste skøn indberettet under R0260 under hensyn til overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. |
| C0020-C0170/ R0470 | Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen | Angiv værdien af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af volatilitetsjusteringen, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med volatilitetsjusteringen. |
| C0180/R0470 | Forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Samlede skadesforsikringsforpligtelser | Angiv den samlede værdi, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af volatilitetsjusteringen, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med volatilitetsjusteringen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0020-C0170/ R0480 | Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering | Beløbet for det bedste skøn indberettet i R0260 under hensyn til volatilitetsjustering, for hver branche |
| C0180/R0480 | Det bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering — samlede skadesforsikringsforpligtelser | Angiv den samlede værdi, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, af det bedste skøn indberettet under R0260 under hensyn til volatilitetsjusteringen. |
| C0020-C0170/ R0490 | Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger | Beløbet for forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og uden volatilitetsjusteringen. |
| C0180/R0490 | Forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — samlede skadesforsikringsforpligtelser | Den samlede værdi, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, af forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering. I de tilfælde, hvor de samme bedste skøn også var omfattet af overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser/overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, skal den værdi, der indberettes under denne post, afspejle værdien uden overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og uden volatilitetsjusteringen. |
| C0020, C0030, C0040, C0050, C0060, C0070, C0080, C0090, C0100, C0110, C0120, C0130, C0140, C0150, C0160 og C0170/R0500 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | Beløb for forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for hver branche, som defineret i bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180/R0500 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — skadesforsikringsforpligtelser i alt | Samlet beløb for forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for skadesforsikringsforpligtelser. |

S.17.02 — Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring — Efter land

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder. Skemaet udfyldes ikke, når de nedenfor anførte tærskler for indberetning efter land ikke finder anvendelse, dvs. når hjemlandet tegner sig for 100 % eller mere af summen af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet som helhed og det bedste bruttoskøn. Når dette beløb er over 90 %, men lavere end 100 %, indberettes kun R0010, R0020, R0030, R0040, R0050, R0060, R0070, R0080 og R0090.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne eller landene skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskler.

Direkte sygeforsikringsvirksomhed, der udøves på et forsikringsmæssigt grundlag, der svarer til livsforsikring, skal segmenteres i branchen skadesforsikring 1-3.

Virksomheder skal tage hensyn til alle forpligtelserne i forskellige valutaer og omregne dem til indberetningsvalutaen.

Oplysningerne efter land skal indberettes i overensstemmelse med følgende:

- Oplysninger om hjemlandet skal altid indberettes uanset værdien af forsikringsmæssige hensættelser under et og bedste bruttoskøn (vedrører direkte forsikringsvirksomhed).
- Oplysninger indberettet efter land skal mindst udgøre 90 % af de samlede forsikringsmæssige hensættelser under et og bedste bruttoskøn (vedrører direkte forsikringsvirksomhed) for enhver branche.
- Hvis der skal indberettes et bestemt land for en særlig branche for at opfylde litra b), skal det pågældende land indberettes for alle brancher.
- De øvrige lande skal indberettes aggregeret i »andre EØS« eller »andre ikke-EØS«.
- Med hensyn til direkte forsikringsvirksomhed for brancherne »Udgifter til lægebehandling«, »Indkomstsikring«, »Arbejdsskedeforsikring«, »Brand og andre skader på ejendom« og »Kredit- og kautionsforsikring« skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor risikoen består, som defineret i artikel 13, nr. 13), i direktiv 2009/138/EF.
- Med hensyn til direkte forsikringsvirksomhed for alle andre brancher, som ikke er omhandlet i litra e), skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor kontrakten blev indgået.

I dette skema forstås ved »det land, hvor kontrakten blev indgået«:

- det land, hvor forsikringselskabet er etableret (hjemland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial eller i henhold til reglerne om den frie udveksling af tjenesteydelser
- det land, hvor filialen er beliggende (værtsland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial
- det land, hvor retten til fri udveksling af tjenesteydelser blev meddelt (værtsland), hvis kontrakten blev solgt i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser
- Hvis der blev anvendt en mægler, eller i enhver anden situation, gælder a), b) eller c), afhængigt af hvem der solgte kontrakten.

De oplysninger, der skal indberettes, skal omfatte volatilitetsjustering, matchtilpasning, overgangsjustering på den relevante risikofrie rentekurve og overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser.

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010 | Land 1 ... | ISO 3166-1 alpha-2-koden én række for hvert krævet land inden for væsentlighedstærsklen. |
| Z0010 | Type virksomhed | En af følgende valgmuligheder anvendes: 1 — sygeforsikring 2 — Accepteret proportional genforsikring Den rette værdi mellem mulighed a) og b), |
| C0020-C0130/ R0010 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — hjemland | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter land, hvor risikoen består, eller land, hvor aftalen blev indgået, hvis landet er hjemlandet, for hver branche, kun vedrørende direkte forsikringsvirksomhed (undtagen accepteret genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive korrekte data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0130/ R0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), undtagen for hjemlandet, for hver branche, kun vedrørende direkte forsikringsvirksomhed (undtagen accepteret genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive korrekte data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0130/ R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), for hver branche, kun vedrørende direkte forsikringsvirksomhed (undtagen accepteret genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive korrekte data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0130/ R0041 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed — Hjemland | Beløbet for forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter den direkte forsikringstagers land, for hver branche, kun vedrørende accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive korrekte data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0130/ R0050 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed — EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), undtagen forsikringssselskabets land for hver branche, vedrørende accepteret proportional genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0130/ R0060 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande, accepteret proportional genforsikringsvirksomhed — ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), for hver branche, kun vedrørende accepteret proportional genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0140-C0170/ R0070 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande for accepteret ikke-proportional genforsikringsvirksomhed — Hjemland | Beløbet for forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter den direkte forsikringstagers land, for hver branche, kun vedrørende accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0140-C0170/ R0080 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande for accepteret ikke-proportional genforsikringsvirksomhed — EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), undtagen det direkte forsikringssselskabs land for hver branche, vedrørende accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0140-C0170/ R0090 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, beregnet under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed — ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen — ikke indberettet efter land | Beløbet for forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn for ikke-EØS-lande uden for væsentlighedstærsklen (dvs. dem, der ikke indberettes separat efter land), for hver branche, kun vedrørende accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0020-C0130/ R0100 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — Land 1 [én række for hvert land inden for væsentlighedstærsklen] | Værdi af forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter land, hvor risikoen består, eller land, hvor aftalen blev indgået, for hver branche, kun vedrørende direkte forsikringsvirksomhed eller accepteret proportional genforsikringsvirksomhed kun afhængig af Z0020 (undtagen accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed). I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0140-C0170/ R0110 | Forsikringsmæssige hensættelser, brutto, under et og bedste bruttoskøn for forskellige lande — Land 1 [én række for hvert land inden for væsentlighedstærsklen] for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed | Beløbet for forsikringsmæssige bruttohensættelser beregnet under et og bedste bruttoskøn efter land, hvor risikoen består, eller land, hvor aftalen blev indgået, for hver branche, kun vedrørende accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. I nogle tilfælde kan det være nødvendigt for selskaber at anvende vurderinger/approximationer for at kunne indgive relevante data, der er i overensstemmelse med de antagelser, der er anvendt til beregningen af forsikringsmæssige hensættelser. |

SR.18.01 — Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Skadesforsikring)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema indberettes for den væsentlige skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, hvilket udgør en dækning på 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring. Brancherne indberettes i henhold til beløbet for forsikringsmæssige hensættelser, dvs. branchen med det højeste beløb for forsikringsmæssige hensættelser.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskler.

Hvis selskabet anvender forenklinger ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser, for hvilke et skøn over de forventede fremtidige cash flow hidrørende fra kontrakterne ikke beregnes, skal oplysningerne ikke indberettes.

Dette skema gælder kun for bedste skøn og følgende skal tages i betragtning:

- Alle cash flow udtrykt i forskellige valutaer skal tages i betragtning og omregnes til indberetningsvalutaen ved hjælp af vekselkursen på indberetningsdatoen.
- Cash flow skal indberettes uden fradrag af genforsikring og udiskonteret.

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010/R0010- R0310 | Det bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) — likviditetstab — fremtidige ydelser | Beløbet for alle forventede betalinger til forsikringstagere og begunstigede som defineret i artikel 78, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser, der falder ind under aftalen, anvendt til beregningen af præmiehensættelser, fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0020/R0010-R0310 | Det bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) — likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | Beløbet for alle udgifter, som påløber i forbindelse med forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, som defineret i artikel 78, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF og artikel 31 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og andre likviditetstabsposter som f.eks. skattebetalinger, som pålægges forsikringstagere, anvendt til beregningen af præmiehensættelser, og som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0030/R0010-R0310 | Det bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) — likviditetstilførsler — fremtidige præmier | Beløbet for alle fremtidige præmier fra eksisterende policer, undtagen forfaldne præmier, som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser, anvendt til beregningen af præmiehensættelser, fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0040/R0010-R0310 | Det bedste skøn over præmiehensættelser (brutto) — likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | Genindvundne beløb fra restværdi og subrogation (heri ikke medregnet investeringsafkast), anvendt til beregningen af præmiehensættelser, og som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0050/R0010-R0310 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) — likviditetstab — fremtidige ydelser | Beløbet for alle forventede betalinger til forsikringstagere og begunstigede som defineret i artikel 78, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF, som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser og er relateret til eksisterende aftaler, anvendt til beregningen af erstatningshensættelser, fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0060/R0010-R0310 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) — likviditetstab — fremtidige udgifter og andre likviditetstab | Beløbet for alle udgifter, som påløber i forbindelse med forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, som defineret i artikel 78, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF, og andre cash flow-poster som f.eks. skattebetalinger, som pålægges forsikringstagere, anvendt til beregningen af erstatningshensættelser, og som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0070/R0010-R0310 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) — likviditetstilførsler — fremtidige præmier | Beløbet for alle fremtidige præmier fra eksisterende policer, undtagen forfaldne præmier, som vedrører hele porteføljen af skadesforsikringsforpligtelser, anvendt til beregningen af erstatningshensættelser, fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0080/R0010-R0310 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser (brutto) — likviditetstilførsler — andre likviditetstilførsler | Genindvundne beløb fra restværdi og subrogation (heri ikke medregnet investeringsafkast), anvendt til beregningen af erstatningshensættelser, og som vedrører hele porteføljen og er relateret til eksisterende aftaler fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. |
| C0090/R0010-R0310 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (efter justeringen) | Beløbet for udiskonterede cash flow forventet hvert år fra år 1 til år 30 og fra år 31 og derefter. De fremtidige udiskonterede cash flow fra beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring/fra SPV'er og finite reinsurance, herunder cederet koncernintern genforsikring, herunder fremtidige genforsikringspræmier. Værdi skal indberettes med fradrag af justering for modpartsrisiko. |
| C1000/R1000 | Brancher, som er omfattet | Angiv de vigtigste brancher, som er taget i betragtning, i dette skema. Følgende udtømmende liste med flere valgmuligheder anvendes: 1 – 1 og 13 Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 – 2 og 14 Indkomstsikring 3 – 3 og 15 Arbejdsskadeforsikring 4 – 4 og 16 Motoransvarsforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|--|
| | | 5 – 5 og 17 Anden motorforsikring 6 – 6 og 18 Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 – 7 og 19 Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 – 8 og 20 Almindelig ansvarsforsikring 9 – 9 og 21 Kredit- og kautionsforsikring 10 – 10 og 22 Retshjælpsforsikring 11 – 11 og 23 Assistance 12 – 12 og 24 Diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. 28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |

S.19.01 — Skadesforsikringserstatninger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Trekanter for udvikling i krav viser forsikringsselskabets skøn over erstatningsudgifter (udbetalte erstatninger og erstatningshensættelser i henhold til Solvens II-værdiansættelsesprincippet), og hvordan dette skøn udvikler sig over tid.

Der kræves tre sæt trekanter vedrørende udbetalte erstatninger, det bedste skøn over erstatningshensættelser og anmeldte, men ikke afregnede krav.

Dette skema skal indberettes for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, idet der tages hensyn til følgende specifikationer:

- i. Indberetning efter branche: Brancherne 1-12 skal indberettes (som indberettet under S.17.01) for både direkte og accepteret proportional genforsikringsvirksomhed (skal indberettes sammen) og brancherne 25-28 for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, der tegner sig for en dækning på 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring. Brancherne skal vælges ved anvendelse af de forsikringsmæssige hensættelser i faldende orden.
- ii. Hvis det samlede bedste bruttoskøn over en skadesforsikringsbranche udgør mere end 10 % af det samlede bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, skal oplysningerne indberettes med følgende opdeling efter valutaer, ud over det samlede beløb for branchen:
 - a) beløb for alle valutaer, der udgør mere end 25 % af det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelserne fra den pågældende skadesforsikringsbranche eller
 - b) beløb for alle valutaer, der udgør mindre end 25 % af det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelserne fra den pågældende skadesforsikringsbranche, men mere end 5 % af det samlede bedste bruttoskøn over alle erstatningshensættelser.
- iii. Hvis det bedste bruttoskøn for én skadesforsikringsbranche udgør mindre end 10 % af det samlede bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser, kræves der ikke opdeling efter valuta, kun det samlede beløb for branchen skal indberettes.
- iv. Oplysningerne efter valuta skal indberettes i den oprindelige valuta for aftalerne, medmindre andet er angivet.
- v. For captive-forsikrings- og -genforsikringsselskaber, der opfylder betingelserne i artikel 4, stk. 4 og 5, indberettes dette skema uden valutaopdeling, dvs. i Z0030 indberettes altid det samlede beløb.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne eller valutaerne skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskler.

Selskaberne skal indberette oplysningerne på ulykkesår- eller forsikringsårsbasis i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskaberne anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

Standardvarigheden af afviklingstrekanten er 15 + 1 år for alle brancher, men indberetningskravet er baseret på selskabernes udvikling i krav (hvis varigheden af skadeserstatningscyklussen er kortere end 15 år, skal selskaberne indberette i overensstemmelse med den interne kortere udvikling).

Der kræves historiske data, startende fra førstegangsansøgningen af Solvens II, for udbetalte erstatninger og anmeldte, men ikke afregnede krav, men ikke for det bedste skøn over erstatningshensættelser. For så vidt angår udarbejdelse af historiske data for udbetalte erstatninger og anmeldte, men ikke afregnede krav, anvendes den samme fremgangsmåde vedrørende trekantens længde for løbende indberetning (dvs. 15 + 1 år eller selskabernes skadeserstatningscyklus, alt efter hvad der er kortest).

Hele eller dele af en forpligtelse flyttes fra S.19.01 til S.16.01, når nedennævnte betingelser begge er opfyldt:

- i. Hele eller dele af forpligtelsen er formelt afviklet som en annuitet, og
- ii. der kan fastsættes et bedste skøn over en forpligtelse, der formelt er afviklet som en annuitet, ved hjælp af livsforsikringsmetoder.

Formelt afviklet som en annuitet betyder typisk, at det ved en retslig procedure er afgjort, at den begunstigede skal modtage betalinger som en annuitet.

Summen af hensættelser i skema S.16.01 og S.19.01 for en skadesforsikringsvirksomhed, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udgør de samlede erstatningsreserver hidrørende fra denne branche.

Hvis mulighed »2 — indberetningsvaluta« vælges i Z0040 »valutaomregning«, angives standardværdien i Z0030 »valuta«.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|--|
| Z0010 | Branche | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 – 1 og 13 Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>2 – 2 og 14 Indkomstsikring</p> <p>3 – 3 og 15 Arbejdsskadeforsikring</p> <p>4 – 4 og 16 Motoransvarsforsikring</p> <p>5 – 5 og 17 Anden motorforsikring</p> <p>6 – 6 og 18 Sø-, luftfarts- og transportforsikring</p> <p>7 – 7 og 19 Forsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>8 – 8 og 20 Almindelig ansvarsforsikring</p> <p>9 – 9 og 21 Kredit- og kautionforsikring</p> <p>10 – 10 og 22 Retshjælpsforsikring</p> <p>11 – 11 og 23 Assistance</p> <p>12 – 12 og 24 Diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> |
| Z0020 | Ulykkesår eller forsikringsår | <p>Angiv, hvilken standard selskabet anvender ved indberetning af udviklingen i krav. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ulykkesår</p> <p>2 — Forsikringsår.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------------|---|---|
| Z0030 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, forpligtelsen er denomineret i. Denne post skal udfyldes med »I alt« ved indberetning af det samlede beløb for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| Z0040 | Valutaomregning | Angiv, om de oplysninger, der indberettes efter valuta, indberettes i den oprindelige valuta (standard) eller i indberetningsvalutaen (angives i så fald). Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Oprindelig valuta 2 — Indberetningsvaluta Kun relevant, hvis der indberettes efter valuta. |
| C0010- C0160/R0100- R0250 | Udbetalte bruttoerstatninger (ikkekumulativt) — trekant | De udbetalte bruttoerstatninger med fradrag af beløb fra indtrædelsesrettigheder, undtagen udgifter, i en trekant, der viser udviklingen i de allerede udbetalte bruttoerstatninger: for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) indberettes de allerede foretagne betalinger svarende til hvert udviklingsår (hvilket er forsinkelsen mellem ulykkesåret/forsikringsåret og betalingsdatoen). Dataene er i absolutte beløb, ikkekumulative og udiskonterede. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C0170/R0100- R0260 | Udbetalte bruttoerstatninger (ikkekumulativt) — i indeværende år | »Indeværende år« i alt afspejler den sidste diagonal (alle data vedrørende sidste indberetningsår) fra R0100-R0250. R0260 er den samlede værdi af R0100-R0250. |
| C0180/R0100- R0260 | Udbetalte bruttoerstatninger — summen af år (kumulativt) | »Summen af alle år« i alt indeholder summen af alle data i rækker (summen af alle betalinger vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret), herunder i alt. |
| C0200- C0350/R0100- R0250 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, brutto, udiskonteret — trekant | Trekanter for det bedste skøn over erstatningshensættelser, udiskonteret, uden fradrag af genforsikring for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår). Bedste skøn over erstatningshensættelser vedrører forsikringsbegivenheder, som forekom før eller på værdiansættelsesdatoen, uanset om de krav, der er opstået som følge af disse begivenheder, er anmeldt. Dataene er i absolutte beløb, ikkekumulative og udiskonterede, med fradrag af restværdi og subrogation og eksklusive alle former for udgifter og fremtidige præmier. |
| C0360/R0100- R0260 | Det bedste bruttoskøn over erstatningshensættelser — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0100-R0250. R0260 er den samlede værdi af R0100-R0250. |
| C0400- C0550/R0100- R0250 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto — trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for hensættelser for så vidt angår forsikringsbegivenheder, der er indtruffet og er anmeldt til forsikringselskabet, men som endnu ikke er afregnet, undtagen indtrufne, men ikke anmeldte krav. Disse er reserver, der estimeres fra sag til sag af skadesbehandlere, og det er ikke nødvendigt, at de er på grundlag af bedste skøn i henhold til Solvens II. De anmeldte, men ikke afregnede krav skal måles på grundlag af reserver, hvis styrke er konsistent over tid. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|--|---|
| | | Dataene er i absolutte beløb, ikkekumulative og udiskonterede med fradrag af restværdi og subrogation. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C0560/R0100-R0260 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R010-R0250. R0260 er den samlede værdi af R0100-R0250. |
| C0600-C0750/R0300-R0450 | Modtagne beløb i henhold til genforsikringsaftaler (ikkekumulativt) — Trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for betalinger (erstatninger udbetalt af genforsikringsselskabet plus beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler), indberettet under »Udbetalte bruttoerstatninger (ikkekumulativt)«, dækket af en genforsikringsaftale. Beløbene der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler skal tages i betragtning efter justeringen for modpartens misligholdelse. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C0760/R0300-R0460 | Modtagne beløb i henhold til genforsikringsaftaler (ikkekumulativt) — I indeværende år | »Indeværende år« i alt afspejler den sidste diagonal (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0300-R0450. R0460 er den samlede værdi af R0300-R0450. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C0770/R0300-R0450 | Modtagne beløb i henhold til genforsikringsaftaler — Sum af år (kumulativt) | »Summen af år« i alt indeholder summen af alle data i rækker (summen af alle betalinger vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret), herunder i alt. |
| C0800-C0950/R0300-R0450 | Udiskonterede bedste skøn over erstatningshensættelser — beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftale — trekant | Hensættelser, der vedrører beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. I trekanten skal der indberettes udiskonterede data, mens kolonnen »Årets udgang« skal indeholde data på et diskonteret grundlag. Beløbene skal tages i betragtning efter justeringen for modpartens misligholdelse, med fradrag af restværdi og subrogation og eksklusive alle former for udgifter og fremtidige præmier. |
| C0960/R0300-R0460 | Bedste skøn over erstatningshensættelser — beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0300-R0450. R0460 er den samlede værdi af R0300-R0450. |
| C1000-C1150/R0300-R0450 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, genforsikring — trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for genforsikringsandelen af hensættelserne, indberettet under »Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto«, dækket af en genforsikringsaftale. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter, og med fradrag af restværdi og subrogation. |
| C1160/R0300-R0460 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, genforsikring — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0300-R0450. R0460 er den samlede værdi af R0300-R0450. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|--|---|
| C1200-C1350/R0500-R0650 | Udbetalte nettoerstatninger (ikkekumulativt) — trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for udbetalte erstatninger med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation og genforsikring. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C1360/R0500-R0660 | Udbetalte nettoerstatninger (ikkekumulativt) — i indeværende år | »Indeværende år« i alt afspejler den sidste diagonal (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0500-R0650. R0660 er den samlede værdi af R0500-R0650 |
| C1370/R0500-R0660 | Udbetalte nettoerstatninger — summen af år (kumulativt) | »Summen af år« i alt indeholder summen af alle data i rækker (summen af alle betalinger vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret), herunder i alt. |
| C1400-C1550/R0500-R0650 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, netto, udiskonteret — trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for det bedste skøn over erstatningshensættelser, med fradrag af genforsikring og restværdi og subrogation og andre udgifter såvel som eventuelle fremtidige præmier. |
| C1560/R0500-R0660 | Det bedste skøn over erstatningshensættelser, netto, udiskonteret — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0500-R0650. R0660 er den samlede værdi af R0500-R0650 |
| C1600-C1750/R0500-R0650 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, netto — trekant | Trekanter for hvert ulykkesår/forsikringsår fra N-14 (og forudgående) og alle tidligere indberetningsperioder indtil — inklusive — N (sidste indberetningsår) for udestående krav med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation og genforsikring. Heri indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men andre udgifter medregnes ikke. |
| C1760/R0500-R0660 | Anmeldte, men ikke afregnede krav, netto — årets udgang (diskonterede data) | »Årets udgang« i alt afspejler den sidste diagonal, men på et diskonteret grundlag (alle data vedrører sidste indberetningsår) fra R0500-R0650. R0660 er den samlede værdi af R0500-R0650. |

Inflationsrater (kun hvis der anvendes metoder, der tager højde for inflationen for at korrigere dataene)

| | | |
|-------------------|---|---|
| C1800-C1940/R0700 | Historisk inflationsrate — i alt | Hvis der anvendes afviklingssteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere dataindberetning efter år og for 15 år, anvendes den historiske inflationsrate til at justere historiske trekanter over betalte tab. |
| C1800-C1940/R0710 | Historisk inflationsrate — eksternt inflation | Hvis der anvendes afløbsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere data, der er indberettet efter år, indberettes for de 15 år den historiske eksterne inflation: som er den »økonomiske« eller »almindelige« inflation, dvs. stigningen i prisen på varer og tjenesteydelser i en specifik økonomi (f.eks. forbrugerprisindeks, producentprisindeks osv.) |
| C1800-C1940/R0720 | Historisk inflationsrate — endogen inflation | Hvis der anvendes afviklingsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere dataindberetning efter år og for 15 år, er den historiske endogene inflation: som er en stigning i omkostningerne ved erstatninger, som er specifikke for den pågældende branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C2000-C2140/ R0730 | Forventet inflationsrate — i alt | Hvis der anvendes afløbsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere data, der er indberettet efter år, indberettes for de 15 år den forventede inflationsrate, der er anvendt til trekanter, der er justeret for historiske tab. |
| C2000-C2140/ R0740 | Forventet inflationsrate — ekstern inflation | Hvis der anvendes afløbsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere data, der er indberettet efter år, indberettes for de 15 år den forventede eksterne inflation: som er den »økonomiske« eller »almindelige« inflation, dvs. stigningen i prisen på varer og tjenesteydelser i en specifik økonomi (f.eks. forbrugerprisindeks, producentprisindeks osv.) |
| C2000-C2140/ R0750 | Forventet inflationsrate — endogen inflation | Hvis der anvendes afløbsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere data, der er indberettet efter år, indberettes for de 15 år den forventede endogene inflation: som er en stigning i omkostningerne ved erstatninger, som er specifikke for den pågældende branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C2200/R0760 | Beskrivelse af den anvendte inflationsrate | Hvis der anvendes afløbsteknikker, som eksplicit tager højde for inflationen for at korrigere de indberettede data, indberettes en narrativ beskrivelse af den anvendte inflationsrate. |

S.20.01 — Udvikling i fordelingen af erstatningsudgifter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit giver en oversigt over afvikling/bevægelser i skadesforsikringsporteføljer, både hvad angår udbetalte erstatninger (opdelt efter erstatningstype) og anmeldte, men ikke afregnede krav (som defineret i S.19.01).

Anmeldte, men ikke afregnede krav, indberettes udiskonteret.

Dette skema udfyldes for hver væsentlig skadesforsikringsbranche for direkte forsikringsvirksomhed, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, hvilket udgør en dækning på 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring. Branchen skal vælges ved anvendelse af de forsikringsmæssige hensættelser i faldende orden.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskler.

Med hensyn til antallet af krav, der skal indberettes, skal selskaberne anvende deres specifikke definition eller, hvis en sådan findes, den på nationalt plan fastsatte specifikation (f.eks. krav fastsat af den nationale tilsynsmyndighed). Hvert krav skal dog indberettes én gang efter branche. Hvis et krav afsluttes og genåbnes i løbet af året, skal det ikke indberettes i kolonnen »Genåbnede krav i løbet af året«, men i den relevante kolonne vedrørende »Udestående krav ved årets begyndelse« eller »Krav anmeldt i løbet af året«.

Selskaberne skal indberette oplysningerne ved en metode baseret på ulykkesår- eller forsikringsår i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskabet anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

Hvad angår antal år, der skal indberettes, finder det indberetningskrav, der gælder i S.19.01, anvendelse.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------|--|
| Z0010 | Branche | Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | | <p>4 — Motoransvarsforsikring</p> <p>5 — Anden motorforsikring</p> <p>6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring</p> <p>7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>8 — Almindelig ansvarsforsikring</p> <p>9 — Kredit- og kautionsforsikring</p> <p>10 — Retshjælpsforsikring</p> <p>11 — Assistance</p> <p>12 — Diverse økonomiske tab</p> |
| Z0020 | Ulykkesår/forsikringsår | <p>Angiv, hvilken standard selskabet anvender ved indberetning af udviklingen i krav. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ulykkesår</p> <p>2 — Forsikringsår.</p> |
| C0020/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, udestående krav ved årets udgang — Antal krav | <p>Antal udestående krav ved årets begyndelse, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> |
| C0030/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved årets begyndelse. | <p>Beløb for anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved årets begyndelse, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0040/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, udestående krav ved årets udgang — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0050/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved udgangen af perioden. | <p>Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved udgangen af perioden, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløb for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0060/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Antal krav afsluttet med betaling | Antal udestående krav ved årets begyndelse, som er afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14. |
| C0070/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved årets begyndelse. | Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, som er udestående ved årets begyndelse og afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0080/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Bruttobetaling i årets løb | Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er afsluttet ved indberetningsårets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan allokere til specifikke krav. |
| C0090/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet uden betaling — Antal krav afsluttet uden betaling | Antal udestående krav ved årets begyndelse, som er afsluttet ved årets udgang og afregnet uden betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14. |
| C0100/R0010-R0160 | Anmeldte, men ikke afregnede krav. Udestående krav ved årets begyndelse, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet uden betaling — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved årets begyndelse, afregnet uden betaling. | Anmeldte, men ikke afregnede krav, opgjort brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, som er udestående ved årets begyndelse og ved årets udgang og afregnet uden betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0110/R0010-R0160 | Krav anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Antal krav | Antal udestående krav ved årets begyndelse, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0120/R0010-R0160 | Anmeldte krav i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb, og som stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0130/R0010-R0160 | Krav anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved udgangen af perioden. | <p>Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved udgangen af perioden, vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og stadig udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløb for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0140/R0010-R0160 | Udestående krav anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Antal krav afsluttet med betaling | <p>Antal krav anmeldt i årets løb, som er afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> |
| C0150/R0010-R0160 | Anmeldte krav i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang afregnet med betaling — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0160/R0010-R0160 | Krav anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet uden betaling — Antal krav afsluttet uden betaling | <p>Antal krav anmeldt i årets løb, som er afsluttet ved årets udgang og afregnet uden betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> |
| C0170/R0010-R0160 | Krav genåbnet i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Antal krav | <p>Antal udestående krav ved årets begyndelse, der stadig er udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0180/R0010-R0160 | Krav genåbnet i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er genåbnet i årets løb, og som stadig er udestående ved årets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0190/R0010-R0160 | Krav genåbnet i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved udgangen af perioden. | <p>Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved udgangen af perioden, vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og stadig udestående ved indberetningsårets udgang, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløb for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0200/R0010-R0160 | Krav genåbnet i årets løb, lukkede krav ved årets udgang — Antal krav afregnet med betaling | <p>Antal krav genåbnet i årets løb, som er afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, tallet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede tal for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> |
| C0210/R0010-R0160 | Krav genåbnet i årets løb, afsluttede krav ved periodens udgang — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er genåbnet i årets løb og afsluttet ved årets udgang med betaling, efter ulykkesår/forsikringsår fra år N-1 (året før indberetningsåret) til N-14, beløbet for alle tidligere indberetningsperioder før N-14 og det samlede beløb for alle årene fra N-1 til før år N-14.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |
| C0110/R0170 | Krav anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Antal krav | <p>Antal krav anmeldt i årets løb, som stadig er udestående ved årets udgang, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N.</p> |
| C0120/R0170 | Anmeldte krav i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Bruttobetaling i årets løb | <p>Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og stadig udestående ved indberetningsårets udgang, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N.</p> <p>Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0130/R0170 | Krav anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved udgangen af perioden. | Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved udgangen af perioden vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og stadig udestående ved indberetningsårets udgang, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0140/R0170 | Udestående krav anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Antal krav afsluttet med betaling | Antal krav anmeldt i årets løb og afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N. |
| C0150/R0170 | Anmeldte krav i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang afregnet med betaling — Bruttobetaling i årets løb | Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav, der er anmeldt i årets løb og afsluttet ved årets udgang og afregnet med betaling, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0160/R0170 | Krav anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet uden betaling — Antal krav afsluttet uden betaling | Antal krav anmeldt i årets løb og afsluttet ved årets udgang og afregnet uden betaling, vedrørende ulykkesåret/forsikringsåret, i tilknytning til indberetningsår N. |
| C0110/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Antal krav | Samlet antal krav anmeldt i årets løb, der stadig er udestående ved årets udgang. |
| C0120/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Bruttobetaling i årets løb | Bruttobetaling i alt, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende det samlede antal anmeldte krav i årets løb, der stadig er udestående ved årets udgang. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0130/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, udestående krav ved årets udgang — Anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, ved udgangen af perioden. | Anmeldte, men ikke afregnede krav i alt, brutto, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, ved udgangen af perioden, vedrørende det samlede antal anmeldte krav i årets løb, der stadig er udestående ved årets udgang. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0140/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Antal krav afsluttet med betaling | Samlet antal krav anmeldt i årets løb og afregnet med betaling. |
| C0150/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet med betaling — Bruttobetaling i årets løb | Bruttobetaling, med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation, foretaget i årets løb vedrørende krav anmeldt i årets løb og afregnet med betaling. Heri medregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. |
| C0160/R0180 | Krav i alt anmeldt i årets løb, afsluttede krav ved årets udgang, afregnet uden betaling — Antal krav afsluttet uden betaling | Samlet antal krav anmeldt i årets løb og afregnet uden betaling. |

S.21.01 — Risikoprofil for fordeling af tab

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema indberettes for hver væsentlig skadesforsikringsbranche for direkte forsikringsvirksomhed, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, hvilket udgør en dækning på 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring. Brancherne indberettes i henhold til beløbet for forsikringsmæssige hensættelser, dvs. branchen med det højeste beløb for forsikringsmæssige hensættelser.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskel.

Tabfordelingsprofilen for skadesforsikringsvirksomhed viser fordelingen, inden for (på forhånd fastlagte) intervaller, af akkumulerede erstatningsudgifter ved indberetningsårets udgang.

Ved akkumulerede erstatningsudgifter forstås summen af udbetalte bruttoerstatninger og anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, fra sag til sag for hvert enkelt krav, udestående eller afsluttet, som vedrører et bestemt ulykkesår/forsikringsår. I erstatningsudgifterne indregnes alle elementer, som udgør selve kravet, men ikke andre udgifter end dem, der kan fordeles på specifikke krav. Oplysninger vedrørende erstatningsudgifter indberettes med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation. Der kræves historiske data, startende fra førstegangsansøgningen af Solvens II.

Selskaberne skal indberette oplysningerne på ulykkesår- eller forsikringsårsbasis i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskabet anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

De standardintervaller, der skal anvendes, udtrykkes i euro. Hvis der er tale om forskellige indberetningsvalutaer, skal hver relevant tilsynsmyndighed fastsætte de pågældende valgmuligheder for de beløb, der skal anvendes i de 20 intervaller.

Selskaberne kan anvende selskabsspecifikke intervaller, navnlig hvis erstatningsudgifterne er under 100 000 EUR. De valgte intervaller skal anvendes konsekvent for indberetningsperioderne, medmindre der sker en væsentlig ændring i fordelingen af erstatningsudgifter. I så fald skal selskabet underrette tilsynsmyndigheden på forhånd, medmindre tilsynsmyndigheden allerede har fastlagt intervallerne.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|-----------------------------|--|
| Z0010 | Branche | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskedeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab |
| Z0020 | Ulykkesår/forsikringsår | <p>Angiv, hvilken standard selskabet anvender ved indberetning af skema S 19.01. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Ulykkesår 2 — Forsikringsår. |
| C0030/R0010-R0210 | Start — Erstatningsudgifter | <p>Startpunkt for det pågældende interval.</p> <p>Hvis indberetningsvalutaen er euro, kan en af følgende fem basismuligheder baseret på den normale tabsfordeling anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 – 20 intervaller af 5000 plus et ekstra åbent interval for akkumulerede erstatningsudgifter > 100 000. 2 – 20 intervaller af 50000 plus et ekstra åbent interval for akkumulerede erstatningsudgifter > 1 mio. 3 – 20 intervaller af 250 000 plus et ekstra åbent interval for akkumulerede erstatningsudgifter > 5 mio. 4 – 20 intervaller af 1 mio. plus et ekstra åbent interval for akkumulerede erstatningsudgifter > 20 mio. 5 – 20 intervaller af 5 mio. plus et ekstra åbent interval for erstatningsudgifter > 100 mio. <p>Selskaberne bør dog anvende selskabsspecifikke intervaller, navnlig når de akkumulerede erstatningsudgifter er < 100 000, for at sikre, at detaljeringsgraden er tilstrækkelig til at give et passende indblik i fordelingen af de akkumulerede erstatningsudgifter, medmindre tilsynsmyndigheden ikke allerede har lagt sig fast.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| | | <p>Den valgte mulighed skal anvendes konsekvent for indberetningsperioderne, medmindre der sker en væsentlig ændring i fordelingen af erstatningsudgifter.</p> <p>Hvis der er tale om forskellige indberetningsvalutaer, skal de nationale tilsynsmyndigheder fastsætte de pågældende valgmuligheder for de beløb, der skal anvendes i de 20 intervaller.</p> |
| C0040/R0010-R0200 | Slut — Erstatningsudgifter | Endepunkt for det pågældende interval. |
| C0050, C0070, C0090, C0110, C0130, C0150, C0170, C0190, C0210, C0230, C0250, C0270, C0290, C0310 og C0330/R0010-R0210 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N:N-14 | Antal krav fordelt på hvert af ulykkesårene/forsikringsårene N til N-14, for hvilke erstatningsudgifterne ved indberetningsårets udgang ligger inden for det pågældende intervals endepunkter. Antallet af krav er summen af det akkumulerede antal udestående krav ved periodens udgang plus det akkumulerede antal afsluttede krav afregnet med betaling. |
| C0060, C0080, C0100, C0120, C0140, C0160, C0180, C0200, C0220, C0240, C0260, C0280, C0300, C0320 og C0340/R0010-R0210 | Erstatningsudgifter i alt, ulykkesår/forsikringsår N:N-14 | <p>Akkumulerede og aggregerede erstatningsudgifter for alle individuelle krav, fordelt på hvert af ulykkesårene/forsikringsårene N til N-14, for hvilke de akkumulerede erstatningsudgifter ved indberetningsårets udgang ligger inden for det pågældende intervals endepunkter.</p> <p>For mindre erstatningsudgifter tillades skøn (f.eks. standardbeløb), hvis blot de er i overensstemmelse med de beløb, der indgår i afviklingstrekantene som indberettet i skema S.19.01 vedrørende skadesforsikringserstatningsudgifter.</p> <p>Ved akkumulerede erstatningsudgifter forstås summen af udbetalte bruttoerstatninger og anmeldte, men ikke afregnede krav, brutto, fra sag til sag for hvert enkelt krav, udestående og afsluttet, som vedrører et bestemt ulykkesår/forsikringsår.</p> |
| C0050, C0070, C0090, C0110, C0130, C0150, C0170, C0190, C0210, C0230, C0250, C0270, C0290, C0310 og C0330/R0300 | Antal krav ulykkesår/forsikringsår N:N-14 — I alt | Samlet antal akkumulerede og aggregerede krav for alle intervaller for hvert af årene N til N-14. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|---|
| C0060, C0080, C0100, C0120, C0140, C0160, C0180, C0200, C0220, C0240, C0260, C0280, C0300, C0320 og C0340/R0300 | Erstatningsudgifter i alt, ulykkesår/forsikringsår N:N-14 — I alt | Akkumulerede og aggregerede erstatningsudgifter i alt for alle intervaller for hvert af årene N til N-14. |

S.21.02 — Skadesforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Skemaet skal indberettes vedrørende skadesforsikringsvirksomhed (herunder ikke-SLT-sygeforsikring), men kun for direkte forsikringsvirksomhed.

I dette skema indberettes de 20 største forsikringsrisici, baseret på nettotilbageholdelse, for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Hvis de to største enkelte forsikringsrisici for en branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, ikke dækkes af ovenstående metodologi, skal de indberettes særskilt. Hvis en enkelt forsikringsrisiko for en bestemt branche er en del af de 20 største, indberettes denne risiko for den pågældende branche kun én gang.

Ved nettotilbageholdelse for den enkelte forsikringsrisiko forstås selskabets størst mulige forpligtelse efter hensyntagen til beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikring (herunder SPV'er og finite reinsurance), og til forsikringstagerens oprindelige selvrisiko. Hvis nettotilbageholdelsen er den samme for for mange risici, anvendes den højeste forsikringssum som det næste kriterium. Hvis forsikringssummen også er den samme, anvendes den mest hensigtsmæssige risiko under hensyn til selskabets risikoprofil som det endelige kriterium.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0010 | Risikoidentifikationskode | Koden er et unikt identifikationsnummer tildelt af selskabet, som identificerer den pågældende risiko, og som skal forblive uændret i de efterfølgende årlige indberetninger. |
| C0020 | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | Hvis risikoen vedrører et selskab, angives navnet på det selskab, som risikoen vedrører. Hvis risikoen vedrører en fysisk person, pseudonymiseres det oprindelige police-nummer, og der indberettes pseudonymiserede oplysninger. Ved pseudonymiserede data forstås data, som ikke kan knyttes til en bestemt person uden brug af yderligere oplysninger, og sådanne yderligere oplysninger opbevares særskilt. Der skal sikres konsistens over tid. Det er ensbetydende med, at enkeltstående forsikringsrisici, som optræder fra år til år, skal have det samme pseudonymiserede format. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0030 | Risikobeskrivelse | Beskrivelse af risikoen. Afhængigt af branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indberettes det, hvilken type selskab, bygning eller beskæftigelse den specifikke forsikringsrisiko er knyttet til. |
| C0040 | Branche | <p>Navn på branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>2 — Indkomstsikring</p> <p>3 — Arbejdsskadeforsikring</p> <p>4 — Motoransvarsforsikring</p> <p>5 — Anden motorforsikring</p> <p>6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring</p> <p>7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>8 — Almindelig ansvarsforsikring</p> <p>9 — Kredit- og kaufionsforsikring</p> <p>10 — Retshjælpsforsikring</p> <p>11 — Assistance</p> <p>12 — Diverse økonomiske tab</p> |
| C0050 | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Beskrivelsen af den dækkede risikokategori er enhedsspecifik og ikke obligatorisk. Endvidere er udtrykket »risikokategori« ikke baseret på den terminologi, der anvendes i forbindelse med niveau 1 og 2, men kan betragtes som endnu en mulighed for at give yderligere oplysninger om den eller de givne forsikringsrisici. |
| C0060 | Gyldighedsperiode (startdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning blev påbegyndt, dvs. den dato, hvor dækningen trådte i kraft. |
| C0070 | Gyldighedsperiode (slutdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning udløb. |
| C0080 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den oprindelige valuta. |
| C0090 | Forsikringssum | <p>Det største beløb, som forsikringsselskabet kan blive forpligtet til at udbetale i henhold til policen. Forsikringssummen er knyttet til forsikringsrisikoen.</p> <p>Hvis policen dækker en række eksponeringer/risici i landet, angives den individuelle forsikringsrisiko, som har den højeste nettotilbageholdelse. Hvis risikoen er accepteret på grundlag af coassurance, svarer forsikringssummen til det indberettede skadesforsikringsselskabs maksimale forpligtelse. I tilfælde af solidarisk hæftelse medregnes også den del, der vedrører en misligholdende co-assurandør.</p> |
| C0100 | Forsikringstagerens oprindelige selvrisiko | Den del af forsikringssummen, som forsikringstageren har som selvrisiko. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|---|
| C0110 | Type forsikringsmodel | <p>Den type forsikringsmodel, som anvendes til at danne sig et skøn over eksponeringen i forbindelse med forsikringsrisikoens og over behovet for genforsikringsdækning. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Forsikringssum:</p> <p>Det største beløb, som forsikringsselskabet kan blive forpligtet til at udbetale i henhold til den oprindelige police. Forsikringssummen skal også angives, hvis type forsikringsmodel ikke er relevant.</p> <p>2 — Største mulige tab:</p> <p>Det tab, som kan opstå ved en mere eller mindre tilfældig kombination af de mest uheldige omstændigheder; branden standses kun på grund af ikke passerbare genstande eller manglende materiale.</p> <p>3 — Største sandsynlige tab:</p> <p>Det er defineret som et skøn over det største tab på grund af en enkeltstående brand eller risiko, der kan forventes, idet det antages, at den mest uheldige enkeltstående hindring for primære private brandsikringssystemer gør sig gældende, men at sekundære sikringssystemer eller -organer (f.eks. en indsats fra beredskabsorganer og et privat og/eller offentligt brandkorps) fungerer som forventet. Katastrofesituationer, f.eks. eksplosioner på grund af et massivt udslip af brandfarlige gasser, som kunne omfatte store områder af driftsanlægget, detonation af massive sprængstoffer, seismiske forstyrrelser, flodbølger eller oversvømmelser, flystyrt og brandstiftelse på mere end et enkelt område indgår ikke i dette skøn. Denne definition er en kombination af det største mulige og det største skønnede tab, som normalt accepteres og ofte anvendes af forsikringsselskaber, genforsikrings-selskaber og reassurancemæglere.</p> <p>4 — Største skønnede tab:</p> <p>Det tab, som med rimelighed kan forventes at blive påført som følge af de uforudsete forhold, der tages i betragtning, på grund af en enkeltstående hændelse, der anses for at være en mulighed under hensyntagen til de faktorer, der sandsynligvis vil forøge eller reducere tabets omfang, herunder dog ikke sådanne tilfældigheder og katastrofer, som kan være mulige, men som forbliver usandsynlige.</p> <p>5 — Andet:</p> <p>Det er defineret som andre forsikringsmodeller, der kan anvendes. Det skal i den regelmæssige tilsynsrapport forklares, hvilke »andre« typer forsikringsmodeller der anvendes.</p> <p>Selv om ovennævnte definitioner anvendes i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, »Forsikring mod brand og andre skader på ejendom«, kunne lignende definitioner eventuelt anvendes i forbindelse med andre brancher.</p> |
| C0120 | Beløb i henhold til forsikringsmodel | <p>Det største tab som følge af den enkelte forsikringsrisiko i henhold til den anvendte forsikringsmodel. Hvis der ikke anvendes nogen specifik type forsikringsmodel, skal beløbet være lig med forsikringssummen i C0090 minus den oprindelige selvrisiko indberettet i C0100.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0130 | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring hos alle genforsikringselskaber | Den del af forsikringssummen, som forsikringselskabet har genforsikret på fakultativ basis (ved aftale og/eller ved individuel dækning) hos genforsikringselskaberne. Hvis den fakultative dækning ikke er 100 %, men kun 80 %, skal de resterende 20 % anses som tilbageholdelse. |
| C0140 | Beløb dækket ved genforsikring hos alle genforsikringselskaber, ikke fakultativ | Den del af forsikringssummen, som forsikringselskabet har genforsikret ved traditionelle genforsikringsaftaler eller på anden måde (inklusive SPV'er og finite reinsurance), bortset fra fakultativ genforsikring. |
| C0150 | Forsikringselskabets nettotilbageholdelse | Det nettobeløb, for hvilket forsikringselskabet er risikobærer, dvs.: den del af forsikringssummen, som overstiger forsikringstagerens oprindelige selvrisko, og som ikke er genforsikret. |

S.21.03 — Fordeling af skadesforsikringsrisici — efter forsikringssum

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle selskaber.

Dette skema indberettes for hver væsentlig skadesforsikringsbranche for direkte forsikringsvirksomhed, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, hvilket udgør en dækning på 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring. Brancherne indberettes i henhold til beløbet for forsikringsmæssige hensættelser, dvs. branchen med det højeste beløb for forsikringsmæssige hensættelser.

De negative forsikringsmæssige hensættelser for brancherne skal tages i betragtning med den absolutte værdi i forbindelse med beregningen af ovennævnte væsentlighedstærskel.

Forsikringsrisikoporteføljen er fordelingen, i (forud fastlagte) intervaller, af forsikringssummen for hver enkelt forsikringsrisiko, som selskabet har påtaget sig. Forsikringsrisikoporteføljen er pr. branche. Mens nogle brancher obligatorisk skal indberettes i alle medlemsstater, kan de enkelte medlemsstater også kræve obligatorisk indberetning for yderligere brancher, hvis de anser det for at være relevant. For nogle brancher finder skemaet ikke anvendelse. (Se også posten »Branche«).

De standardintervaller, der skal anvendes, udtrykkes i euro. Hvis der er tale om forskellige indberetningsvalutaer, skal hver relevant tilsynsmyndighed fastsætte de pågældende valgmuligheder for de beløb, der skal anvendes i de 20 intervaller.

Selskaberne kan anvende selskabsspecifikke intervaller, navnlig hvis forsikringssummen er under 100 000 EUR. De valgte intervaller skal anvendes konsekvent for indberetningsperioderne, medmindre der sker en væsentlig ændring i fordelingen af erstatningsudgifter. I så fald skal selskabet underrette tilsynsmyndigheden på forhånd, medmindre tilsynsmyndigheden allerede har fastlagt intervallerne.

Referencedatoen skal som standard være udgangen af indberetningsåret, men med behørig begrundelse kan selskabet som referencedato vælge den dato, hvor oplysningerne indhentes gennem policeadministrationen. Det betyder, at forsikringsrisikoporteføljen f.eks. kan baseres på den samme referencedato som den, der anvendes til at indsamle lignende oplysninger med henblik på forlængelse af genforsikringsaftaler og fakultativ dækning.

Forsikringssummen vedrører hver enkelt forsikringsrisiko, idet der kun tages hensyn til policens hoveddækning pr. branche, og er det højeste beløb, som forsikringselskabet kan være forpligtet til at udbetale. Det betyder:

- Hvis forsikringssummen for den supplerende dækning vedrørende »Tyveri« er lavere end forsikringssummen for hoveddækningen vedrørende »Forsikring mod brand og anden skade på ejendom« (begge under samme branche), skal den højeste forsikringssum vælges.
- En policedækning, der omfatter en række bygninger i landet eller en bilflåde osv. skal opdeles.

- Hvis risikoen er accepteret på grundlag af coassurance, svarer forsikringssummen til det indberettende skadesforsikrings-selskabs maksimale forpligtelse.
- I tilfælde af solidarisk hæftelse gennem co-assurance medregnes i summen også den del, der vedrører en misligholdende co-assurandør.

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|------------------------|--|
| Z0010 | Branche | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Første kategori: Brancher, der er obligatoriske for alle medlemsstater:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Anden motorforsikring — Sø-, luftfarts- og transportforsikring — Brand og andre skader på ejendom — Kredit- og kautionsforsikring. <p>Anden kategori: Brancher, som de enkelte nationale tilsynsmyndigheder kan vælge skal være obligatoriske:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Motoransvarsforsikring — Almindelig ansvarsforsikring — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Indkomstsikring — Arbejdsskadeforsikring — Diverse økonomiske tab — Retshjælpsforsikring — Assistance. <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab |
| C0020/R0010– R0210 | Start — Forsikringssum | Startpunkt for det interval, som forsikringssummen vedrørende den enkelte forsikringsrisiko hører til, og som skal aggregeres. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---------------------------------|---|
| | | <p>Hvis indberetningsvalutaen er euro, kan en af følgende 5 basisvalgmuligheder for fordelingen af forsikringsrisiciene anvendes:</p> <p>1 – 20 intervaller af 25000 plus et ekstra interval for forsikringssum > 500 000. 2 – 20 intervaller af 50000 plus et ekstra interval for forsikringssum > 1 mio. 3 – 20 intervaller af 250 000 plus et ekstra interval for forsikringssum > 5 mio. 4 – 20 intervaller af 1 mio. plus et ekstra interval for forsikringssum > 20 mio. 5 – 20 intervaller af 5 mio. plus et ekstra interval for forsikringssum > 100 mio.</p> <p>Selskaberne skal dog anvende selskabsspecifikke intervaller, navnlig når forsikringssummen er < 100 000, for at sikre, at detaljeringsgraden er tilstrækkelig til at give passende indblik i fordelingen af erstatningsudgifter, medmindre den allerede er fastlagt af tilsynsmyndigheden.</p> <p>For policer, hvor der ikke er fastsat nogen forsikringssum i policen, skal selskaberne foretage deres egne skøn eller anvende standardværdier.</p> <p>Den valgte mulighed skal anvendes konsekvent for indberetningsperioderne, medmindre der sker en væsentlig ændring i fordelingen af erstatningsudgifter.</p> <p>Hvis der er tale om forskellige indberetningsvalutaer, skal de nationale tilsynsmyndigheder fastsætte de pågældende valgmuligheder for de beløb, der skal anvendes i de 20 intervaller.</p> |
| C0030/R0010–R0200 | Slut — forsikringssum | Endepunkt for det interval, som forsikringssummen vedrørende den enkelte forsikringsrisiko hører til, og som skal aggregeres. |
| C0040/R0010–R0210 | Antal forsikringsrisici | Antal forsikringsrisici, hvis forsikringssum ligger inden for startpunktet og endepunktet for det pågældende interval. |
| C0040/R0220 | Antal forsikringsrisici — I alt | Samlet antal forsikringsrisici indberettet i alle intervaller. |
| C0050/R0010–R0210 | Forsikringssum i alt | Den aggregerede forsikringssum, på bruttobasis, i indberetningsvalutaen, for alle de individuelle forsikringsrisici, hvis forsikringssum ligger inden for startpunktet og endepunktet for det pågældende interval. |
| C0050/R0220 | Samlet forsikringssum — I alt | De aggregerede forsikringssum i alt, på bruttobasis, indberetningsvalutaen, for alle de individuelle forsikringsrisici i alle intervaller. |
| C0060/R0010–R0210 | Årlige tegnede præmier i alt | Aggregeret beløb for tegnede præmier som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35 for de underliggende forsikringsrisici. |
| C0060/R0220 | Samlede tegnede præmier — I alt | Aggregeret beløb i alt for de årlige tegnede præmier indberettet i alle intervaller. |

S.22.01 — Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema anvendes, når mindst én langsigtet garanti eller overgangsforanstaltning anvendes af selskabet.

Formålet med dette skema er at give et billede af virkningen på den finansielle stilling, når der ikke anvendes overgangsforanstaltninger, og hver langsigtet garanti eller overgangsforanstaltning sættes til nul. Med henblik herpå bør der anvendes en trinvis kumulativ metode, hvor hver overgangsforanstaltning og langsigtet garanti tages en efter en, og uden at genberegne virkningen af de resterende foranstaltninger efter hvert trin.

Virkningerne skal indberettes som positive, hvis de øger størrelsen af den indberettede post, og negative, hvis de reducerer postens størrelse (hvis f.eks. solvenskapitalkravet stiger, eller hvis kapitalgrundlaget stiger, så indberettes der positive værdier).

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0010 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, inklusive langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0010 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0010 | Virkning af overgangsforanstaltninger på forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justering af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0010 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0010 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den risikofrie rentekurve og de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0060/R0010 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af eventuelle justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0070/R0010 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Forsikringsmæssige hensættelser | Værdien af justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det største af de beløb for de forsikringsmæssige hensættelser, der er indberettet under C0010, C0020 og C0040. |
| C0080/R0010 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0010 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det største af de beløb for de forsikringsmæssige hensættelser, der er indberettet under C0010, C0020, C0040 og C0060. |
| C0100/R0010 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justering af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0020 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0020 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0020 | Virkning af overgangsforanstaltninger på forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.« |
| C0040/R0020 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0020 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesats — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0020 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0020 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0020 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0020 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. »Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0020 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0030 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0020/R0030 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |
| C0030/R0030 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af de overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0030 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0030 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0030 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0030 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0030 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0030 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0030 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0040 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0040 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningsjusteringen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0040 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Beløbet for justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og som følge af anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0040/R0040 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0040 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og under anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0040 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0040 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og under anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0040 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0040 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og under anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | | Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0040 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchtilpasningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og under anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0050 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0050 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0050 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0050 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0050 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. »Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0060/R0050 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0050 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0050 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0050 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0050 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0060 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0060 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0030/R0060 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0060 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0060 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0060 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0060 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0060 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0090/R0060 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0060 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0070 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0070 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |
| C0030/R0070 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0070 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0070 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | | Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0070 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0070 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0070 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0070 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. »Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0070 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0080 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0020/R0080 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |
| C0030/R0080 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0080 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0080 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0080 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0080 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | | »Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0080 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0080 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0080 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0090 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0090 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0090 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0090 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0050/R0090 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0090 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0090 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0090 | Uden matchtilpasning og uden alle de øvrige — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0090 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0090 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0100 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0100 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | | Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0100 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0100 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0100 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0100 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0100 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0100 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | | Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0100 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0100 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0110 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Minimumskapitalkrav | Samlet minimumskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0110 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Minimumskapitalkrav | Samlet minimumskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0110 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Minimumskapitalkrav | Den del af justeringen af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0110 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Minimumskapitalkrav | Samlet minimumskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0110 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Minimumskapitalkrav | Den del af justeringen af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0060/R0110 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Minimumskapitalkrav | Samlet minimumskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0110 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Minimumskapitalkrav | Den del af justeringen af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0110 | Uden matchtilpasning og uden alle de øvrige — Minimumskapitalkrav | Samlet minimumskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0110 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Minimumskapitalkrav | Den del af justeringen af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem minimumskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og minimumskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0110 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Minimumskapitalkrav | Den del af justeringen af minimumskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010-C0100/R0120 | Med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkravsprocent | Solvenskapitalkravsprocenten beregnes under hensyntagen til de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0010 i hver kolonne. Det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet (R0050) divideret med det samlede solvenskapitalkrav (R0090) i hver kolonne. |
| C0010-C0100/R0130 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Minimumskapitalprocent | Minimumskapitalkravsprocenten beregnes under hensyntagen til de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0010 i hver kolonne. Det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet (R0100) divideret med det samlede minimumskapitalkrav (R0110) i hver kolonne. |

S.22.02 — Fremskrivning af fremtidige cash flow (Bedste skøn — Matchtilpasningsporteføljer)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes for hver matchtilpasningsportefølje, der er godkendt af tilsynsmyndigheden.

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|--|--|
| Z0010 | Matchtilpasningsportefølje | Angiv det nummer, der er tildelt af selskabet, og som svarer til det unikke nummer, der tildeles hver matchtilpasningsportefølje. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere matchtilpasningsporteføljen i andre skemaer. |
| C0020/R0010-R0450, | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden — Likviditetstab i forbindelse med levetids-, dødeligheds- og genoptagelsesforpligtelser | Fremtidigt likviditetstab i tilknytning til levetids-, dødeligheds- og genoptagelsesydelse vedrørende forsikrings- og genforsikringsforpligtelser for hver matchtilpasningsportefølje og opdelt efter året for betaling af cash flowet, hvor perioden på 12 måneder påbegyndes på indberetningens referencedato. |
| C0030/R0010-R0450, | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden — Likviditetstab i forbindelse med udgifter | Fremtidigt likviditetstab i tilknytning til udgifter vedrørende forsikrings- og genforsikringsforpligtelser for hver matchtilpasningsportefølje og opdelt efter året for betaling af cash flowet, hvor perioden på 12 måneder påbegyndes på indberetningens referencedato. |
| C0040/R0010-R0450, | Fremskrivning af fremtidige cash flow ved udgangen af indberetningsperioden — Risikoreducerede cash flow for aktiver | Cash flow (likviditetstab og likviditetstilførsel) for aktiver i tilknytning til hver matchtilpasningsportefølje og efter året for rettidig betaling eller modtagelse af cash flowet. Disse cash flow skal justeres behørigt for at tage højde for sandsynligheden for misligholdelse eller den relevante del af det langsigtede gennemsnit for kreditspænd over den risikofrie rente, jf. artikel 53 i delegeret forordning EU 2015/35. |
| C0050/R0010-R0450, | Misforhold i løbet af indberetningsperioden — Positivt udiskonteret misforhold (indgående strømme > udgående strømme) | Hvis hyppigheden er mindre end årlig, indberettes summen af de positive udiskonterede misforhold (indgående strømme > udgående strømme) i årets løb for hver række. Positive misforhold for nogle perioder modregnes ikke i negative misforhold. |
| C0060/R0010-R0450, | Misforhold i løbet af indberetningsperioden — Negativt udiskonteret misforhold (indgående strømme < udgående strømme) | Hvis hyppigheden er mindre end årlig, indberettes summen af de negative udiskonterede misforhold (indgående strømme < udgående strømme) i årets løb for hver række. Negative misforhold for nogle perioder modregnes ikke i positive misforhold. |

S.22.03 — Oplysninger om beregning af matchtilpasning

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes for hver matchtilpasningsportefølje, der er godkendt af tilsynsmyndigheden.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|----------------------------|---|
| Z0010 | Matchtilpasningsportefølje | Angiv det nummer, der er tildelt af selskabet, og som svarer til det unikke nummer, der tildeles hver matchtilpasningsportefølje. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere matchtilpasningsporteføljen i andre skemaer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | <i>Overordnet beregning af matchtilpasningen</i> | |
| C0010/R0010 | Årlig effektiv rente anvendt på cash flowet for forpligtelserne | Den årlige effektive rente, beregnet som den enkelte diskonteringsrate, der anvendt på cash flow for porteføljen af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser giver en værdi svarende til værdien i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF af den tilknyttede aktivportefølje. |
| C0010/R0020 | Årlig effektiv rente svarende til bedste skøn | Den årlige effektive rente, beregnet som den enkelte diskonteringsrate, der anvendt på cash flow for porteføljen af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser, giver en værdi svarende til værdien af det bedste skøn for porteføljen af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser, hvor der tages hensyn til tidsværdien under anvendelse af den tilgrundliggende risikofrie rentekurve. |
| C0010/R0030 | Sandsynlighed for misligholdelse anvendt til at risikoreducere cash flow vedrørende aktiver | Sandsynligheden for misligholdelse svarer til den værdi udtrykt i procent (samme format som for række R0010 og R0020), der anvendes til at justere cash flowene for aktiver i den tilknyttede aktivportefølje i henhold til artikel 53 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Ved »risikoreducerede cash flow« for et aktiv forstås »forventede cash flow for et aktiv«, jf. artikel 53 i delegeret forordning (EU) 2015/35. I dette beløb medregnes ikke den stigning, der indberettes i række R0050. |
| C0010/R0040 | Del af det grundlæggende kreditspænd, der ikke afspejles ved risikoreduktion af cash flow for aktiver. | Den del af det grundlæggende kreditspænd, der ikke er afspejlet i justeringen af cash flowene for den tilknyttede aktivportefølje, jf. artikel 53 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi udtrykkes i procent (samme format som række R0010 og R0020). I dette beløb medregnes ikke den stigning, der indberettes i række R0050. |
| C0010/R0050 | Stigning i det grundlæggende kreditspænd for aktiver, der er sub-investment grade | Stigning i det grundlæggende kreditspænd for aktiver, der er sub-investment grade, udtrykt i procent (samme format som række R0010, R0020 og R0120). Der skal tages hensyn til stigningen i sandsynligheden for misligholdelse for aktiver, der er sub-investment grade, ved risikoreduceringen af cash flow. |
| C0010/R0060 | Matchtilpasning af den risikofrie rente | Matchtilpasningen af den risikofrie rente for den indberettede portefølje, udtrykt i basispoint som decimaltal, f.eks. indberettes 100 bp som 0,01. |
| | <i>Anerkendelseskriterier vedrørende solvenskapitalkravet under hensyn til dødelighedsrisicistress</i> | |
| C0010/R0070 | Dødelighedsrisicistress med henblik på matchtilpasningen. | Stigning i det bedste bruttoskøn beregnet med den grundlæggende risikofrie rente efter et dødelighedsrisicistress sammenlignet med det bedste bruttoskøn beregnet med den grundlæggende risikorente, jf. artikel 77b, stk. 1, litra f), i direktiv 2009/138/EF og artikel 52 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | <i>Portefølje</i> | |
| C0010/R0080 | Markedsværdi af aktiverne i porteføljen | Solvens II-værdi af aktiverne i porteføljen. |
| C0010/R0090 | Inflationsafhængig markedsværdi af aktiver | Solvens II-værdi af aktiverne med afkast afhængigt af inflationen (artikel 77b, stk. 1), i direktiv 2009/138/EF). |
| C0010/R0100 | Inflationsafhængigt bedste skøn | Den del af det bedste skøn over cash flow vedrørende forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser, der er afhængig af inflationen. |
| C0010/R0110 | Markedsværdi af aktiver, hvor tredjemand kan ændre cash flow | Værdi af aktiver, hvor tredjemand kan ændre cash flow (artikel 77b, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF). |
| C0010/R0120 | Afkast af aktiver — porteføljearbejd | Angiv den risikoreducerede interne forrentning af aktiverne i tilknytning en eventuel matchtilpasningsportefølje målt som den diskonteringsrate, til hvilken nutidsværdien af et aktivs cash flow er lig med nutidsværdien af dets risikoreducerede likviditetstilførsel. |
| C0010/R0130 | Markedsværdi af genkøbte aftaler | Bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, der udspringer af de for hver matchtilpasningsportefølje underliggende aftaler, som er blevet genkøbt i løbet af indberetningsperioden. |
| C0010/R0140 | Antal genkøbsoptioner, der er udnyttet | Antal genkøbsoptioner, der er udnyttet i løbet af indberetningsperioden, vedrørende forsikrings- og genforsikringsforpligtelser for hver matchtilpasningsportefølje. |
| C0010/R0150 | Markedsværdi af aktiver i tilknytning til genkøbte aftaler | Værdi af aktiverne, værdiansat i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, i tilknytning til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, der er genkøbt, på det tidspunkt, hvor genkøbsoptionerne blev udnyttet. |
| C0010/R0160 | Beløb udbetalt til forsikringstagere | Værdi af beløb udbetalt til forsikringstagere i henhold til deres genkøbsrettigheder. Dette beløb adskiller sig fra række R0130 og R0150, hvor genkøbsklausulen i aftalen ikke giver forsikringstageren ret til at modtage det fulde beløb i de nævnte rækker. |
| | <i>Forpligtelser</i> | |
| C0010/R0170 | Varighed | Macaulay-varighed for forpligtelser under hensyn til alle cash flow for forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser i tilknytning til porteføljer, hvor der er anvendt matchtilpasning. |

S.22.04 — Overgangsforanstaltninger for beregning af rentesatser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal indberettes efter valuta, for hvilken overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve anvendes. Ved udfyldelsen af C0020 skal der kun tages hensyn det garanterede bedste skøn over forpligtelser i tilknytning til produkter med garanteret rente. Fremtidige diskretionære ydelser medregnes ikke.

Sondringen mellem Solvens I-renteintervaller vil kunne foretages efter homogene risikogrupper.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | <i>Overordnet beregning af overgangsjusteringen</i> | |
| Z0010 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for hver valuta, for hvilken overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve anvendes. |
| C0010/R0010 | Solvens I-rente | Renten (udtrykt som et decimaltal) som fastsat af forsikrings- eller genforsikrings-selskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv. |
| C0010/R0020 | Årlig effektiv rente | Den årlige effektive rente, beregnet som den enkelte diskonteringsats, der anvendt på cash flow for porteføljen af tilladelige forsikrings- og genforsikringsforpligtelser giver en værdi svarende til værdien af det bedste skøn for porteføljen af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser, hvor der tages hensyn til tidsværdien under anvendelse af den relevante risikofrie rentekurve, jf. artikel 77, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0010/R0030 | Andel af forskellen anvendt på indberetningsdatoen | Procentandel (udtrykt som et decimaltal) af forskellen mellem Solvens I-renten (R0010) og den årlige effektive rente (R0020) (f.eks. 1,00 ved begyndelsen af overgangsperioden og 0,00 ved udløbet). |
| C0010/R0040 | Justering af den risikofrie rente | Overgangsjustering af den risikofrie rente udtrykt i procent (som et decimaltal). |
| | <i>Solvens I-rente</i> | |
| C0020/R0100 | Bedste skøn — Op til 0,5 % | <p>Det bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var op til 0,5 % (inklusive).</p> <p>Kun det garanterede bedste skøn over forpligtelser i tilknytning til produkter med garanteret rente medregnes. Fremtidige diskretionære ydelser medregnes ikke.</p> |
| C0020/R0110-R0200 | Bedste skøn — mellem 0,5 % og 8,0 % | <p>Det bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var i det pågældende interval.</p> <p>Den laveste referenceværdi er eksklusiv, og den højeste referenceværdi er inklusiv.</p> <p>Kun det garanterede bedste skøn over forpligtelser i tilknytning til produkter med garanteret rente medregnes. Fremtidige diskretionære ydelser medregnes ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0020/R0210 | Bedste skøn — Over til 8,0 % | <p>Det bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var over 8,0 % (eksklusive).</p> <p>Kun det garanterede bedste skøn over forpligtelser i tilknytning til produkter med garanteret rente medregnes. Fremtidige diskretionære ydelser medregnes ikke.</p> |
| C0030/R0100 | Gennemsnitlig varighed af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser — Op til 0,5 % | <p>Macaulay-restvarighed for forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var op til 0,5 % (inklusive).</p> |
| C0030/R0110-R0200 | Gennemsnitlig varighed af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser — mellem 0,5 % og 8,0 % | <p>Macaulay-restvarighed for forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var i det pågældende interval.</p> <p>Den laveste referenceværdi er eksklusiv, og den højeste referenceværdi er inklusiv.</p> |
| C0030/R0210 | Gennemsnitlig varighed af forsikrings- og genforsikringsforpligtelser — Over 8,0 % | <p>Macaulay-restvarighed for forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, for hvilke renten som fastsat af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i overensstemmelse med de love og administrative bestemmelser, der er vedtaget i henhold til artikel 20 i direktiv 2002/83/EF, på den sidste dato for anvendelse af nævnte direktiv var over 8,0 % (eksklusive).</p> |

S.22.05 — Overordnet beregning af overgangsforanstaltningerne for forsikringsmæssige hensættelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Forsikringsmæssige hensættelser efter Solvens II — dag 1 | <p>Forsikringsmæssige hensættelser, omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter fradrag af beløb, der kan kræves tilbagebetalt i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er, beregnet i overensstemmelse med artikel 76 i direktiv 2009/138/EF, på den første dato for anvendelse af direktiv 2009/138/EF. I beregningen skal indgå alle forsikrings- og genforsikringsforpligtelser på den første dato for anvendelse af direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Hvis der i henhold til artikel 308d, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF er blevet anmodet om en genberegning, skal der i denne beregning kun indgå de forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, der er omfattet af overgangsforanstaltninger, og som stadig består på datoen for genberegningen værdiansat på indberetningsdatoen (Solvens II-værdi minus aftaler, der ikke længere findes).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0020 | Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter fradrag af beløb, der kan kræves tilbagebetalt i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er, beregnet i overensstemmelse med artikel 76 i direktiv 2009/138/EF, på indberetningsdatoen, før anvendelse af overgangsforanstaltningerne. |
| C0010/R0030 | Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Bedste skøn | <p>Bedste skøn, omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter fradrag af beløb, der kan kræves tilbagebetalt i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er, beregnet i overensstemmelse med artikel 76 i direktiv 2009/138/EF, på indberetningsdatoen, før anvendelse af overgangsforanstaltningerne.</p> <p>Hvis der i henhold til artikel 308d, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF er blevet anmodet om en genberegning, skal der i denne beregning kun indgå de forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, der er omfattet af overgangsforanstaltninger, og som stadig består på datoen for genberegningen værdiansat på indberetningsdatoen (Solvens II-værdi minus aftaler, der ikke længere findes).</p> |
| C0010/R0040 | Overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser —risikomargin | <p>Risikomargin, omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter fradrag af beløb, der kan kræves tilbagebetalt i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er, beregnet i overensstemmelse med artikel 76 i direktiv 2009/138/EF, på indberetningsdatoen, før anvendelse af overgangsforanstaltningerne.</p> <p>Hvis der i henhold til artikel 308d, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF er blevet anmodet om en genberegning, skal der i denne beregning kun indgå de forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, der er omfattet af overgangsforanstaltninger, og som stadig består på datoen for genberegningen værdiansat på indberetningsdatoen (Solvens II-værdi minus aftaler, der ikke længere findes).</p> |
| C0010/R0050 | Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser efter Solvens I | <p>Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter fradrag af beløb, der kan kræves tilbagebetalt i henhold til genforsikringsaftaler, beregnet i overensstemmelse med love og administrative bestemmelser, som er vedtaget i henhold til artikel 15 i direktiv 73/239/EØF, artikel 20 i direktiv 2002/83/EF og artikel 32 i direktiv 2005/68/EF, på dagen før ophævelsen af disse direktiver i henhold til artikel 310 i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Hvis der i henhold til artikel 308d, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF er blevet anmodet om en genberegning, skal der i denne beregning kun indgå de forsikrings- og genforsikringsforpligtelser, som stadig består på referencedatoen for genberegning.</p> |
| C0010/R0060 | Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Del af den justerede forskel | <p>Del i procent (angivet som et decimaltal) af den justerede forskel.</p> <p>Den maksimale del, der kan fratrækkes, falder lineært ved udgangen af hvert år fra 1 i det år, der begynder den 1. januar 2016, til 0 den 1. januar 2032.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0070 | Justering af de forsikringsmæssige hensættelser efter eventuel anvendt begrænsning i henhold til artikel 308d, stk. 4 | Beløb for justering af de forsikringsmæssige hensættelser efter eventuel anvendt begrænsning i henhold til artikel 308d, stk. 4, i direktiv 2009/138/EF. Hvis der ikke er nogen begrænsning, indberettes det beregnede beløb som R0060* (R0010-R0050). |
| C0010/R0080 | Forsikringsmæssige hensættelser efter overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser, efter overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser. |

S.22.06 — Bedste skøn under hensyn til volatilitetsjustering efter land og valuta

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal kun indberettes af forsikrings- og genforsikringselskaber, der anvender volatilitetsjustering i henhold til artikel 77d i direktiv 2009/138/EF.

Dette skema skal afspejle det bedste bruttoskøn over livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering opdelt efter forpligtelsernes valuta og efter det land, som aftalen er indgået i. I det bedste skøn, der indberettes, skal medregnes volatilitetsjusteringen. Det bedste skøn omfattet af matchtilpasning skal ikke indberettes i dette skema.

Der skal indberettes oplysninger vedrørende væsentlige forpligtelser i lande og valutaer, for hvilke der anvendes en valutavolatilitetsjustering, og et eventuelt landetillæg, op til 90 % af de samlede bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering, opgjort efter valuta og land.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|---|
| Z0010 | Branche | Angiv om de indberettede oplysninger vedrører livs- eller skadesforsikringsvirksomhed. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Livsforsikring og SLT-sygeforsikring 2 — Skadesforsikring og sygeforsikring, undtagen virksomhed, der udøves på et grundlag, der svarer til livsforsikring |
| R0010 | Anden valuta end indberetningsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for hver valuta, som indberettes. |

Bedste skøn omfattet af lande- og valutavolatilitetsjustering — I alt og pr. hjemland efter valuta

| | | |
|-------------|--|---|
| C0030/R0020 | Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering (for alle valutaer)/I alt for alle lande | Bedste skøn i alt for alle valutaer og alle lande over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering. |
| C0040/R0020 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i indberetningsvalutaen/I alt for alle lande | Bedste skøn i alt for alle lande over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, i indberetningsvalutaen. |
| C0050/R0020 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i valutaer/I alt for alle lande | Bedste skøn i alt for alle lande over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, efter valuta. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0030/R0030 | Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering (for alle valutaer)/Hjemland | Bedste skøn i alt for alle valutaer, for hjemlandet, over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering. |
| C0040/R0030 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i indberetningsvalutaen/Hjemland | Bedste skøn i alt for hjemlandet over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, i indberetningsvalutaen. |
| C0050/R0030 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i valutaer/Hjemland | Bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, efter valuta for hjemlandet. |

Bedste skøn omfattet af lande- og valutavolatilitetsjustering — Efter land og valuta

| | | |
|-------------|--|--|
| C0020/R0040 | Lande | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for hvert land, som indberettes. |
| C0030/R0040 | Bedste skøn i alt omfattet af volatilitetsjustering (for alle valutaer) — efter land | Bedste skøn i alt, for alle valutaer efter land, over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering. |
| C0040/R0040 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i indberetningsvalutaen — efter land | Bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, for indberetningsvalutaen opdelt efter land. |
| C0050/R0040 | Del af bedste skøn omfattet af volatilitetsjustering tegnet i valutaer — efter land | Bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser omfattet af volatilitetsjustering, efter valuta og efter land. |

5.23.01 — Kapitalgrundlag

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning for individuelle enheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| <i>Basiskapitalgrundlag før fradrag af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer som omhandlet i artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35</i> | | |
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — I alt | Den samlede stamaktiekapital, som besiddes direkte og indirekte (før fradrag af egne aktier). Dette er selskabets samlede stamaktiekapital, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, supplerende kapitalelementer eller resterende supplerende kapitalelementer. Eventuel stamaktiekapital, som ikke fuldt ud opfylder kriterierne, behandles som præferenceaktiekapital og klassificeres i overensstemmelse hermed, uanset hvordan den beskrives eller betegnes. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — kernekapital ubegrænset | Indbetalt stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0010/C0040 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — supplerende kapital | Indkaldt stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0030/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt | Den samlede overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital i selskabet, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer. |
| R0030/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital ubegrænset | Overkurs ved emission vedrørende stamaktier, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital, fordi den vedrører stamaktiekapital, som behandles som ubegrænset kernekapital. |
| R0030/C0040 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende stamaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapital, fordi den vedrører stamaktiekapital, som behandles som supplerende kapital. |
| R0040/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — I alt | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer. |
| R0040/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Kernekapital ubegrænset | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital |
| R0040/C0040 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — supplerende kapital | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0050/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — I alt | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt, som fuldt ud opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer, supplerende kapitalelementer eller resterende supplerende kapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0050/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital begrænset | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital. |
| R0050/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0050/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0070/C0010 | Overskudskapital — I alt | Den samlede overskudskapital, der hører ind under artikel 91, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0070/C0020 | Overskudskapital — kernekapital ubegrænset | Den overskudskapital, jf. artikel 91, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0090/C0010 | Præferenceaktier — I alt | Det samlede beløb for præferenceaktier udstedt af selskabet, som fuldt ud opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer eller resterende supplerende kapitalelementer. |
| R0090/C0030 | Præferenceaktier — kernekapital begrænset | Beløbet for de præferenceaktier udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0090/C0040 | Præferenceaktier — supplerende kapital | Beløbet for de præferenceaktier udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0090/C0050 | Præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Beløbet for de præferenceaktier udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0110/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt | Den samlede overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier i selskabet, som fuldt ud opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer, supplerende kapitalelementer eller resterende supplerende kapitalelementer. |
| R0110/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital begrænset | Værdi af overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0110/C0040 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapital, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som supplerende kapital. |
| R0110/C0050 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som resterende supplerende kapital. |
| R0130/C0010 | Afstemningsreserve — I alt | Den samlede afstemningsreserve består af reserver (f.eks. overført resultat) med fradrag af justeringer (f.eks. ring-fenced fonde). Den skyldes hovedsagelig forskelle mellem regnskabsmæssig værdiansættelse og værdiansættelse i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF. |
| R0130/C0020 | Afstemningsreserve — kernekapital ubegrænset | Afstemningsreserven består af reserver (f.eks. overført resultat) med fradrag af justeringer (f.eks. ring-fenced fonde). Den er hovedsagelig et resultat af forskelle mellem regnskabsmæssig værdiansættelse og værdiansættelse i henhold til direktiv 2009/138/EF. |
| R0140/C0010 | Efterstillet gæld — I alt | Den samlede efterstillede gæld udstedt af selskabet. |
| R0140/C0030 | Efterstillet gæld — kernekapital begrænset | Beløbet for efterstillet gæld udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0140/C0040 | Efterstillet gæld — supplerende kapital | Beløbet for efterstillet gæld udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0140/C0050 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Beløbet for efterstillet gæld udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0160/C0010 | Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto — I alt | De samlede udskudte skatteaktiver netto i selskabet. |
| R0160/C0050 | Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto — resterende supplerende kapital | Beløbet for udskudte skatteaktiver netto i selskabet, som opfylder klassifikationskriterierne for resterende supplerende kapital. Udskudte skatteaktiver, opgjort brutto, anføres her, hvis der er flere udskudte skatteaktiver end udskudte skatteforpligtelser. Hvis de udskudte skatteforpligtelser er større end de udskudte skatteaktiver, skal de udskudte skatteaktiver, opgjort netto, være lig med 0. |
| R0180/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. | Summen af ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0020 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital ubegrænset | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0030 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital begrænset | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0040 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for supplerende kapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0050 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

| | | |
|-------------|---|---|
| R0220/C0010 | Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — I alt | <p>Kapitalgrundlagselementer i alt, jf. regnskabet, som ikke medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II.</p> <p>Disse kapitalgrundlagselementer er enten:</p> <p>i) elementer, som er angivet i listen over kapitalgrundlagselementer, men som ikke opfylder kriterierne for klassificering eller overgangsbestemmelserne, eller</p> <p>ii) elementer, som skal fungere som kapitalgrundlag, som ikke er angivet i listen over kapitalgrundlagselementer og ikke er godkendt af tilsynsmyndigheden, og som ikke er balanceført som gæld.</p> |
|-------------|---|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|--|
| | | Efterstillet gæld, som ikke tæller som basiskapitalgrundlag, skal ikke indberettes her, men på balancen (skema S.02.01) som efterstillet gæld, som ikke tæller som basiskapitalgrundlag. |

Fradrag

| | | |
|-------------|---|--|
| R0230/C0010 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — i alt | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter i henhold til artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0230/C0020 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — kernekapital ubegrænset | Beløbet for det fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som fratrækkes ubegrænsede kernekapitalelementer i henhold til artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0230/C0030 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — kernekapital begrænset | Beløbet for det fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som fratrækkes begrænsede kernekapitalelementer i henhold til artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0230/C0040 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — supplerende kapital | Beløbet for det fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som fratrækkes supplerende kapitalelementer i henhold til artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0230/C0050 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — resterende supplerende kapital | Beløbet for det fradrag vedrørende kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som fratrækkes resterende supplerende kapitalelementer i henhold til artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag

| | | |
|-------------|--|---|
| R0290/C0010 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — i alt | Basiskapitalgrundlagselementer i alt efter fradrag. |
| R0290/C0020 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — kernekapital ubegrænset | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0290/C0030 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — kernekapital begrænset | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0290/C0040 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — supplerende kapital | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0290/C0050 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — resterende supplerende kapital | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

Supplerende kapitalgrundlag

| | | |
|-------------|---|---|
| R0300/C0010 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt — I alt | Udstedt, ikkeindkaldt og ikkeindbetalt stamaktiekapital i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0300/C0040 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0310/C0010 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt — I alt | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt garantikapital og ikkeindkaldte og ikkeindbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0310/C0040 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt garantikapital og ikkeindkaldte og ikkeindbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0320/C0010 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — I alt | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0320/C0040 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0320/C0050 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — resterende supplerende kapital | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0330/C0010 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — I alt | Juridisk bindende forpligtelser i alt til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning. |
| R0330/C0040 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — supplerende kapital | Juridisk bindende forpligtelser til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0330/C0050 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — resterende supplerende kapital | Juridisk bindende forpligtelser til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0340/C0010 | Remburser og garantier henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF — i alt | Remburser og garantier i alt, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0340/C0040 | Remburser og garantier henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Remburser og garantier, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF, og for hvilke det gælder, at de opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0350/C0010 | Remburser og garantier ikke henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF — i alt | Andre rembursere og garantier i alt, som opfylder kriterierne til supplerende kapital eller resterende supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0350/C0040 | Remburser og garantier ikke henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Andre rembursere og garantier, som opfylder kriterierne til supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0350/C0050 | Remburser og garantier ikke henhørende under artikel 96, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF — resterende supplerende kapital | Andre rembursere og garantier, som opfylder kriterierne til resterende supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0360/C0010 | Indkaldelse af supplerende bidrag hos medlemmer henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — i alt | Fremtidige fordringer i alt, som gensidige eller gensidiglignende redersammenslutninger med variable bidrag, der udelukkende forsikrer risici i klasse 6, 12 og 17 i bilag I, del A, kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder. |
| R0360/C0040 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende redersammenslutninger med variable bidrag, der udelukkende forsikrer risici i klasse 6, 12 og 17 i bilag I, del A, kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder. |
| R0370/C0010 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — I alt | Fremtidige fordringer i alt, som disse gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, og som ikke falder ind under artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0370/C0040 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Andre fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, end dem, som er beskrevet i artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0370/C0050 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, stk. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — resterende supplerende kapital | Andre fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, end dem, som er beskrevet i artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0390/C0010 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — I alt | Andre former for supplerende kapitalgrundlag i alt. |
| R0390/C0040 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital | Andre former for supplerende kapitalgrundlag, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0390/C0050 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital | Andre former for supplerende kapitalgrundlag, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0400/C0010 | Samlet supplerende kapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlagselementer i alt. |
| R0400/C0040 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0400/C0050 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

Til rådighed stående og anerkendt kapitalgrundlag

| | | |
|-------------|---|---|
| R0500/C0010 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag og supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af solvenskapitalkravet. |
| R0500/C0020 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — kernekapital ubegrænset | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for at indgå i ubegrænsede kernekapitalelementer, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af solvenskapitalkravet. |
| R0500/C0030 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Kernekapital, begrænset | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for at indgå i begrænsede kernekapitalelementer, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af solvenskapitalkravet. |
| R0500/C0040 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Supplerende kapital | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag og supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for at blive medtaget i supplerende kapital, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af solvenskapitalkravet. |
| R0500/C0050 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Resterende supplerende kapital | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag og supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for at blive medtaget i resterende supplerende kapital, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af solvenskapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0510/C0010 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for kernekapital og supplerende kapital, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af minimumskapitalkravet. |
| R0510/C0020 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Kernekapital ubegrænset | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for at blive medtaget blandt ubegrænsede kernekapitalelementer, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af minimumskapitalkravet. |
| R0510/C0030 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Kernekapital begrænset | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for at blive medtaget blandt begrænsede kernekapitalelementer, og derfor er tilgængelige til opfyldelse af minimumskapitalkravet. |
| R0510/C0040 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Supplerende kapital | Summen af alle basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag som opfylder kriterierne for at blive medtaget i supplerende kapital og derfor er tilgængelige til opfyldelse af minimumskapitalkravet. |
| R0540/C0010 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Det samlede til rådighed stående kapitalgrundlag, der er anerkendt til at dække solvenskapitalkravet. |
| R0540/C0020 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Kernekapital ubegrænset | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af ubegrænset kernekapital — der er anerkendt til at opfylde solvenskapitalkravet. |
| R0540/C0030 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Kernekapital begrænset | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af begrænset kernekapital — der er anerkendt til at opfylde solvenskapitalkravet. |
| R0540/C0040 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Supplerende kapital | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af supplerende kapital, der er anerkendt til at opfylde solvenskapitalkravet. |
| R0540/C0050 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet — Resterende supplerende kapital | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af resterende supplerende kapital, der er anerkendt til at opfylde solvenskapitalkravet. |
| R0550/C0010 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet | De samlede kapitalgrundlagselementer, der er anerkendt til at opfylde minimumskapitalkravet. |
| R0550/C0020 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Kernekapital ubegrænset | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af ubegrænset kernekapital — der er anerkendt til at opfylde minimumskapitalkravet. |
| R0550/C0030 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Kernekapital begrænset | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af begrænset kernekapital — der er anerkendt til at opfylde minimumskapitalkravet. |
| R0550/C0040 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet — Supplerende kapital | Det beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer — i form af supplerende kapital, der er anerkendt til at opfylde minimumskapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------|---|--|
| R0580/C0010 | Solvenskapitalkrav | <p>Det samlede solvenskapitalkrav for selskabet som helhed, som skal svare til det solvenskapitalkrav, der indberettes på det relevante solvenskapitalkrav-skema.</p> <p>Ved kvartalsvis indberetning er dette det seneste beløb for solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes i henhold til artikel 103-127 i direktiv 2009/138/EF, enten beløbet for året eller et senere beløb, hvis solvenskapitalkravet er genberegnet f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen, en overtrædelse eller risiko for overtrædelse af solvenskapitalkravet. Beløbet omfatter ethvert kapitaltillæg, fastsat af den nationale tilsynsmyndighed.</p> <p>Hvis der ikke er foretaget en fuld genberegning for den kvartalsvise indberetning, men selskaber har opdateret solvenskapitalkravet via approksimative størrelser, så kan dette solvenskapitalkrav indberettes i den kvartalsvise indberetning.</p> |
| R0600/C0010 | MCR | Det samlede minimumskapitalkrav for selskabet som helhed, som skal svare til det minimumskapitalkrav, der indberettes på det relevante minimumskapitalkrav-skema. |
| R0620/C0010 | Forhold mellem anerkendt kapitalgrundlag og solvenskapitalkrav | Solvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet divideret med beløbet for solvenskapitalkravet. |
| R0640/C0010 | Forhold mellem anerkendt kapitalgrundlag og minimumskapitalkrav | Minimumskapitalkravprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet divideret med beløbet for minimumskapitalkravet. |
| <i>Afstemningsreserve</i> | | |
| R0700/C0060 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Overskydende aktiver i forhold til passiver som indberettet i Solvens II-balancen. |
| R0710/C0060 | Egne aktier (som besiddes direkte og indirekte) | Beløbet for egne aktier, som besiddes af selskabet, såvel direkte som indirekte. |
| R0720/C0060 | Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer | <p>Udbytter, udlodninger og gebyrer, som kan påregnes af selskabet. Så snart der påregnes et udbytte, indberegnes dette fuldt ud i den kvartalsvise indberetning. Så snart der påregnes et udbytte, skal dette fuldt ud indberegnes i den kvartalsvise indberetning på én gang, hvilket betyder, at det ikke skal tilføjes gradvist for hvert kvartal.</p> <p>Der kan påregnes et udbytte, når betalingen bliver sandsynlig i betragtning af selskabets dividendeudbetalingshistorie, virksomhedsudviklingen i løbet af året, referencedatoen for vurderingen og i givet fald andre relevante forhold.</p> <p>Udbyttet indberettes som påregneligt, indtil det er godkendt på den årlige generalforsamling (og ikke indtil det er blevet udbetalt).</p> |
| R0730/C0060 | Andre basiskapitalgrundlagselementer | Basiskapitalgrundlagselementerne omfattet af artikel 69, litra a), nr. i)-v), artikel 72, litra a), og artikel 76, litra a), samt de basiskapitalgrundlagselementer, som tilsynsmyndigheden har godkendt i henhold til artikel 79 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0740/C0060 | Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Den samlede regulering af afstemningsreserven som følge af forekomsten af begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer. |
| R0760/C0060 | Afstemningsreserve — I alt | Selskabets afstemningsreserve før fradrag af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer som omhandlet i artikel 68 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0770/C0060 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — livsforsikring | Afstemningsreserven indeholder et beløb for overskydende aktiver i forhold til passiver, som svarer til den forventede fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. Denne celle repræsenterer dette beløb uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for selskabets livsforsikringsvirksomhed. |
| R0780/C0060 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — skadesforsikring | Afstemningsreserven indeholder et beløb for overskydende aktiver i forhold til passiver, som svarer til den forventede fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. Denne celle repræsenterer dette beløb uden fradrag af genforsikring og skatter (dvs. uden hensyntagen til deres virkning) for selskabets skadesforsikringsvirksomhed. |
| R0790/C0060 | Samlet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | Det samlede beløb for beregnet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. |

S.23.02 — Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag opdelt efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital (tidligere benævnt tiers)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for individuelle enheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital — Indbetalt — I alt | Den samlede indbetalte stamaktiekapital inklusive egne aktier. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital — indbetalt — kernekapital | Den samlede indbetalte stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, inklusive egne aktier. |
| R0020/C0010 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — I alt | Den samlede indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital inklusive egne aktier. |
| R0020/C0040 | Stamaktiekapital — indkaldt, men endnu ikke indbetalt — supplerende kapital | Den samlede indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, inklusive egne aktier. |
| R0030/C0010 | Beholdning af egne aktier — I alt | Egne aktier i alt, som besiddes af selskabet. |
| R0030/C0020 | Beholdning af egne aktier — kernekapital | Egne aktier i alt, som besiddes af selskabet, og som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0100/C0010 | Samlet stamaktiekapital | Den samlede stamaktiekapital. Bemærk, at beholdning af egne aktier medregnes under enten indbetalt eller indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital. |
| R0100/C0020 | Samlet stamaktiekapital — kernekapital | Den samlede stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. Bemærk, at beholdning af egne aktier medregnes under enten indbetalt eller indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital. |
| R0100/C0040 | Samlet stamaktiekapital — supplerende kapital | Den samlede stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0110/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — I alt | Den samlede indbetalte garantikapital og de samlede indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0110/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — kernekapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for kernekapital |
| R0120/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — I alt | Den samlede garantikapital og de samlede medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som er indkaldt, men endnu ikke indbetalt. |
| R0120/C0040 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — indkaldt, men endnu ikke indbetalt — supplerende kapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital |
| R0200/C0010 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber |
| R0200/C0020 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — kernekapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for kernekapital |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0200/C0040 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — supplerende kapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital |
| R0210/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — I alt | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti. |
| R0210/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — kernekapital | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0210/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0210/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — supplerende kapital | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0210/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0210/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb for daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0220/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — I alt | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option. |
| R0220/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0220/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0220/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0220/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0220/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0230/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0230/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0230/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0230/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0230/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0230/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0300/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti. |
| R0300/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0300/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0300/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0300/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0300/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0310/C0010 | Daterede præferenceaktier — I alt | Daterede præferenceaktier i alt. |
| R0310/C0020 | Daterede præferenceaktier — kernekapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0310/C0030 | Daterede præferenceaktier — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Daterede præferenceaktier, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0310/C0040 | Daterede præferenceaktier — supplerende kapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0310/C0050 | Daterede præferenceaktier — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Daterede præferenceaktier, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0310/C0060 | Daterede præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0320/C0010 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — I alt | Den samlede værdi af udaterede præferenceaktier med en call-option. |
| R0320/C0020 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — kernekapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0320/C0030 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0320/C0040 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0320/C0050 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0320/C0060 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — resterende supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0330/C0010 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Den samlede værdi af udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0330/C0020 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0330/C0030 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0330/C0040 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0330/C0050 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0330/C0060 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0400/C0010 | Præferenceaktier i alt | Præferenceaktier i alt. |
| R0400/C0020 | Præferenceaktier i alt — kernekapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0400/C0030 | Præferenceaktier i alt — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Præferenceaktier, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0400/C0040 | Præferenceaktier i alt — supplerende kapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0400/C0050 | Præferenceaktier i alt — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Præferenceaktier, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0400/C0060 | Præferenceaktier i alt — resterende supplerende kapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0410/C0010 | Dateret efterstillet gæld — I alt | Den samlede daterede efterstillede gæld. |
| R0410/C0020 | Dateret efterstillet gæld — kernekapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for kernekapital. |
| R0410/C0030 | Dateret efterstillet gæld — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den daterede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0410/C0040 | Dateret efterstillet gæld — supplerende kapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0410/C0050 | Dateret efterstillet gæld — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den daterede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0410/C0060 | Dateret efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0420/C0010 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Den samlede udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0420/C0020 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0420/C0030 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0420/C0040 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0420/C0050 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0420/C0060 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0430/C0010 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Den samlede udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0430/C0020 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0430/C0030 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0430/C0040 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0430/C0050 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0430/C0060 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0500/C0010 | Samlet efterstillet gæld — I alt | Den samlede efterstillede gæld. |
| R0500/C0020 | Samlet efterstillet gæld — kernekapital | Den samlede efterstillede gæld, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0500/C0030 | Samlet efterstillet gæld — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den samlede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0500/C0040 | Samlet efterstillet gæld — supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0500/C0050 | Samlet efterstillet gæld — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0500/C0060 | Samlet efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0510/C0070 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — godkendte oprindelige supplerende kapitalbeløb | Det godkendte oprindelige beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under supplerende kapital. |
| R0510/C0080 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — aktuelle supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under supplerende kapital. |
| R0510/C0090 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — godkendte oprindelige resterende supplerende kapitalbeløb | Det godkendte oprindelige beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under resterende supplerende kapital. |
| R0510/C0100 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — aktuelle resterende supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under resterende supplerende kapital. |
| R0520/C0080 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke en metode er godkendt — aktuelle supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket en metode er godkendt under supplerende kapital. |
| R0520/C0100 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke en metode er godkendt — aktuelle resterende supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket en metode er godkendt under resterende supplerende kapital. |

S.23.03 — Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget

Generelle bemærkninger:

Dette skema skal indberettes, hvis værdien af kapitalgrundlaget for kernekapital (tier 1), supplerende kapital (tier 2) og resterende supplerende kapital (tier 3) ændres med mere end 5 % i forhold til det foregående år beregnet som nedenfor.

$$\% \text{ - ændring (T; T - 1)} := \frac{\text{Available Own funds in tier i to cover SCR in T}}{\text{Available Own funds in tier i to cover SCR in T-1}}$$

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for individuelle enheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| <i>Stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indbetalt stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Stigning | Stigning i den indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0010/C0030 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Fald | Fald i den indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0010/C0060 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indbetalt stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0020/C0010 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0020/C0020 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Stigning | Stigning i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0020/C0030 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Fald | Fald i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0020/C0060 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0030/C0010 | Beholdning af egne aktier — Overført fra foregående periode | Beholdning af egne aktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0030/C0020 | Beholdning af egne aktier — Stigning | Stigning i beholdningen af egne aktier i indberetningsperioden. |
| R0030/C0030 | Beholdning af egne aktier — Fald | Fald i beholdningen af egne aktier i indberetningsperioden. |
| R0030/C0060 | Beholdning af egne aktier — Overført til efterfølgende periode | Beholdning af egne aktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0100/C0010 | Samlet stamaktiekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for den samlede stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. R0100/C0010 omfatter beholdning af egne aktier. |
| R0100/C0020 | Samlet stamaktiekapital — Stigning | Stigning i den samlede stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0100/C0030 | Samlet stamaktiekapital — Fald | Fald i den samlede stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0100/C0060 | Samlet stamaktiekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for den samlede stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden

| | | |
|-------------|--|---|
| R0110/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0110/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0110/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0110/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0120/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0120/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0120/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0120/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0200/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Overført fra foregående periode | Samlet saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0200/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0200/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0200/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Bevægelser i indberetningsperioden

| | | |
|-------------|---|--|
| R0210/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Overført fra foregående periode | Beløbet for indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført fra foregående indberetningsperiode |
| R0210/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Stigning | Stigningen i indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0210/C0030 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Fald | Reduktionen i indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0210/C0060 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Beløbet for indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført til efterfølgende indberetningsperiode |
| R0220/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt garantikapital og indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0220/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Stigning | Stigning i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte garantikapital og de indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden. |
| R0220/C0030 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Fald | Fald i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte garantikapital og de indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden. |
| R0220/C0060 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt garantikapital og indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0300/C0010 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — overført fra foregående periode | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført fra foregående indberetningsperiode |
| R0300/C0020 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — stigning | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0300/C0030 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — reduktion | Faldet i det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0300/C0060 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — overført til følgende periode | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført til efterfølgende indberetningsperiode |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| <i>Efterstillede gensidige medlemskonti — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0310/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0310/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0310/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0310/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0310/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0310/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0320/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0320/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0320/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0320/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0320/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0320/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0330/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0330/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0330/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0330/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0330/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0330/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0400/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Overført fra foregående periode | Samlet saldo for efterstillede gensidige medlemskonti overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0400/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Udstedt | Det samlede beløb for efterstillede gensidige medlemskonti, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0400/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Indløst | Det samlede beløb for efterstillede gensidige medlemskonti, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0400/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler det samlede udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti i indberetningsperioden. |
| R0400/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler den samlede stigning/det samlede fald i efterstillede gensidige medlemskonti i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0400/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo i alt for efterstillede gensidige medlemskonti overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Overskudskapital</i> | | |
| R0500/C0010 | Overskudskapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overskudskapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0500/C0060 | Overskudskapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overskudskapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Præferenceaktier — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0510/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0510/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0510/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0510/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0520/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|--|
| R0520/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0520/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0520/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0530/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0530/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0530/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0530/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0600/C0010 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Overført fra foregående periode | Samlet beholdning af præferenceaktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0600/C0020 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Stigning | Stigning i den samlede beholdning af præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0600/C0030 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Fald | Fald i den samlede beholdning af præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0600/C0060 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Overført til efterfølgende periode | Samlet beholdning af præferenceaktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier</i> | | |
| R0610/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0610/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0610/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0610/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0620/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| R0620/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0620/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0620/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0630/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0630/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0630/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0630/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0700/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0700/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Stigning | Stigning i saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0700/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Fald | Fald i saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0700/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Efterstillet gæld — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0710/C0010 | Efterstillet gæld — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0710/C0070 | Efterstillet gæld — kernekapital — Udstedt | Efterstillet gæld, kernekapital, udstedt i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0710/C0080 | Efterstillet gæld — kernekapital — Indløst | Efterstillet gæld, kernekapital, indløst i indberetningsperioden. |
| R0710/C0090 | Efterstillet gæld — kernekapital — Udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0710/C0100 | Efterstillet gæld — kernekapital — Lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, kernekapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0710/C0060 | Efterstillet gæld — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0720/C0010 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0720/C0070 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — udstedt | Efterstillet gæld, supplerende kapital, udstedt i indberetningsperioden. |
| R0720/C0080 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — indløst | Efterstillet gæld, supplerende kapital, indløst i indberetningsperioden. |
| R0720/C0090 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0720/C0100 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, supplerende kapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0720/C0060 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0730/C0010 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0730/C0070 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — udstedt | Efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, udstedt i indberetningsperioden. |
| R0730/C0080 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — indløst | Efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, indløst i indberetningsperioden. |
| R0730/C0090 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0730/C0100 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0730/C0060 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0800/C0010 | Samlet efterstillet gæld — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet efterstillet gæld overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0800/C0070 | Samlet efterstillet gæld — udstedt | Samlet efterstillet gæld udstedt i indberetningsperioden. |
| R0800/C0080 | Samlet efterstillet gæld — Indløst | Samlet efterstillet gæld indløst i indberetningsperioden. |
| R0800/C0090 | Samlet efterstillet gæld — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af samlet efterstillet gæld i indberetningsperioden. |
| R0800/C0100 | Samlet efterstillet gæld — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler ændringer i samlet efterstillet gæld som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0800/C0060 | Samlet efterstillet gæld — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet efterstillet gæld overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver

| | | |
|-------------|--|--|
| R0900/C0010 | Beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver netto — Overført fra foregående periode | Saldo for det beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0900/C0060 | Beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver netto — Overført til efterfølgende periode | Saldo for det beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Bevægelser i indberetningsperioden

| | | |
|-------------|---|---|
| R1000/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Ubegrænsede kernekapitalelementer — Overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1000/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer ubegrænset — Udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer. |
| R1000/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R1000/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som kernekapitalelementer ubegrænset. |
| R1000/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1010/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1010/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer. |
| R1010/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer. |
| R1010/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som kernekapitalelementer begrænset. |
| R1010/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1020/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R1020/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1030/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1030/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1100/C0010 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R1100/C0070 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte samlede beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |
| R1100/C0080 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — indløst | Det i indberetningsperioden indløste samlede beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |
| R1100/C0090 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsvinget i ansættelsen af den samlede værdi af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |
| R1100/C0060 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

Supplerende kapitalgrundlag — Bevægelser i indberetningsperioden

| | | |
|-------------|--|---|
| R1110/C0010 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for det supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1110/C0110 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — nyt beløb gjort tilgængeligt | Nyt supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1110/C0120 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital i indberetningsperioden. |
| R1110/C0130 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — indkaldt som basiskapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1110/C0060 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1120/C0010 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1120/C0110 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — nyt beløb gjort tilgængeligt | Nyt supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1120/C0120 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R1120/C0130 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — indkaldt som basiskapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1120/C0060 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1200/C0010 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet supplerende kapitalgrundlag overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1200/C0110 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Nyt beløb gjort tilgængelige | Nyt supplerende kapitalgrundlag for den samlede supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1200/C0120 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående samlet supplerende kapitalgrundlag i indberetningsperioden. |
| R1200/C0130 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Indkaldt som basiskapitalgrundlag | Samlet supplerende kapitalgrundlag indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1200/C0060 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet supplerende kapitalgrundlag overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

S.23.04 — Liste over kapitalgrundlagselementer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for individuelle enheder.

Dette skema skal indberettes, hvis værdien af kapitalgrundlaget for kernekapital (tier 1), supplerende kapital (tier 2) og resterende supplerende kapital (tier 3) ændres med mere end 5 % i forhold til det foregående år beregnet som nedenfor.

$$\% \text{ - ændring } (T; T - 1) := \frac{\text{Available Own funds in tier } i \text{ to cover SCR in } T}{\text{Available Own funds in tier to cover SCR in } T-1}$$

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0010 | Beskrivelse af efterstillede gensidige medlemskonti | En liste over efterstillede gensidige medlemskonti for et individuelt selskab. |
| C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Beløb (i indberetningsvalutaen) | Værdi af individuelle efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Tier | Angivelse af tier for de efterstillede gensidige medlemskonti. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Kernekapital 2 — Kernekapital — ubegrænset |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>3 — Kernekapital — begrænset</p> <p>4 — Supplerende kapital</p> <p>5 — Resterende supplerende kapital</p> |
| C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. Den oprindelige valuta. |
| C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — jf. overgangsbestemmelser? | <p>Hermed angives, hvorvidt de efterstillede gensidige medlemskonti er omfattet af overgangsbestemmelserne.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne</p> <p>2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne</p> |
| C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Modpart (hvis specifik) | Angiv modparten for de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for de efterstillede gensidige medlemskonti. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Udløbsdato | Udløbsdatoen for de efterstillede gensidige medlemskonti. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0110 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Første indløsningsdato | Datoen for første indløsning af de efterstillede gensidige medlemskonti. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0120 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Oplysninger om senere indløsninger | Datoerne for senere indløsninger af de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0130 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Oplysninger om incitamenter til at indløse | Incitamenterne til indløsning af de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0140 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Varselsperiode | Varsel vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti. Datoen angives her i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0160 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Tilbagekøb i årets løb | Redegørelse for, hvorvidt elementet er blevet tilbagekøbt i årets løb. |
| C0190 | Beskrivelse af præferenceaktier | Angivelse af individuelle præferenceaktier. |
| C0200 | Præferenceaktier — Værdi | Værdien af præferenceaktierne. |
| C0210 | Præferenceaktier — Omfattet af overgangsbestemmelserne? | Angivelse af, hvorvidt præferenceaktierne er omfattet af overgangsbestemmelserne. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne 2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne |
| C0220 | Præferenceaktier — Modpart (hvis specifik) | Angivelse af indehaveren af præferenceaktierne, hvis begrænset til en enkelt part. Hvis aktierne udstedes bredt, angives intet. |
| C0230 | Præferenceaktier — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for præferenceaktierne. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0240 | Præferenceaktier — Første indløsningsdato | Datoen for første indløsning af præferenceaktierne. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0250 | Præferenceaktier — Oplysninger om senere indløsninger | Datoerne for senere indløsninger af præferenceaktierne. |
| C0260 | Præferenceaktier — Oplysninger om incitamenter til at indløse | Incitamenterne til indløsning af præferenceaktierne. |
| C0270 | Beskrivelse af efterstillet gæld | En liste over efterstillet gæld for et individuelt selskab. |
| C0280 | Efterstillet gæld — Værdi | Værdi af den efterstillede gæld. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0290 | Efterstillet gæld — Tier | Angivelse af tier for den efterstillede gæld. |
| C0300 | Efterstillet gæld — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. |
| C0320 | Efterstillet gæld — Långiver (hvis specifik) | Angivelse af långiver for den efterstillede gæld, hvis specifik. Hvis ikke specifik, indberettes denne post ikke. |
| C0330 | Efterstillet gæld — Omfattet af overgangsbestemmelserne? | Her angives, hvorvidt den efterstillede gæld er omfattet af overgangsbestemmelserne. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne 2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne |
| C0350 | Efterstillet gæld — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0360 | Efterstillet gæld — Forfaldsdato | Forfaldsdatoen for den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0370 | Efterstillet gæld — Første indløsningsdato | Datoen for første fremtidige indløsning af den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0380 | Efterstillet gæld — Senere indløsningsdatoer | Datoerne for senere indløsninger af den efterstillede gæld. |
| C0390 | Efterstillet gæld — Oplysninger om incitamenter til at indløse | Oplysninger om incitamentene til indløsning af den efterstillede gæld. |
| C0400 | Efterstillet gæld — Varselsperiode | Varsel vedrørende den efterstillede gæld. Datoen angives her i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0450 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | Angivelse af de andre individuelle emner godkendt af tilsynsmyndigheden for et individuelt selskab. |
| C0460 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Beløb | Beløbet vedrørende andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden |
| C0470 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. |
| C0480 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| C0490 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| C0500 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| C0510 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Dato for tilladelse | Datoen for tilladelsen vedrørende andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden. Denne angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0570 | Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — Beskrivelse | Denne celle skal indeholde en beskrivelse af de kapitalgrundlagselementer jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0580 | Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — I alt | Det samlede beløb for det kapitalgrundlagselement jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II. |
| C0590 | Supplerende kapitalgrundlag — beskrivelse | Oplysninger om ethvert supplerende kapitalgrundlag for et individuelt selskab. |
| C0600 | Supplerende kapitalgrundlag — Beløb | Værdi af ethvert supplerende kapitalgrundlag. |
| C0610 | Supplerende kapitalgrundlag — Modpart | Modparten for ethvert supplerende kapitalgrundlag. |
| C0620 | Supplerende kapitalgrundlag — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for ethvert supplerende kapitalgrundlag. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0630 | Supplerende kapitalgrundlag — Dato for tilladelse | Datoen for tilladelse vedrørende ethvert supplerende kapitalgrundlag. Denne angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |

Justering for ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

| | | |
|-------|--|---|
| C0660 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Nummer | Identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| C0670 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Teoretisk solvenskapitalkrav | Det teoretiske solvenskapitalkrav for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje. |
| C0680 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Teoretisk solvenskapitalkrav (negative resultater sat til nul) | Det teoretiske solvenskapitalkrav. Negative værdier indberettes som nul. |
| C0690 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Overskydende aktiver i forhold til passiver for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje. Denne værdi skal afspejle fradrag af fremtidige overførsler til aktionærer. |
| C0700 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Fremtidige overførsler til aktionærer | Beløbet for fremtidige overførsler til aktionærer for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje, i henhold til artikel 80, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0710 | Ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer — Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Fradraget vedrørende hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje i henhold til artikel 81 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Fradrag vedrørende ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer

| | | |
|-------------|---|--|
| C0970/R0010 | Ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer — Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Det samlede fradrag vedrørende ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer, der er indberettet under C0710. |
|-------------|---|--|

S.24.01 — Kapitalinteresser, der besiddes

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Tabel 1 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser, med henblik på fradrag i henhold til artikel 68, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2015/35

| | | |
|-------|----------------------------|---|
| C0010 | Navn på tilknyttet selskab | Navnet på det tilknyttede selskab, hvori kapitalinteressen besiddes. Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35. Konsoliderede strategiske kapitalinteresser er ikke omfattet. |
| C0020 | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0030 | Aktiv-ID-kodetype | ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------------|---|
| | | <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0020 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0040 | I alt | Hele den samlede værdi for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital (tiers), som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, og som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi). Konsoliderede strategiske kapitalinteresser er ikke omfattet. |
| C0050 | Basiskapitalgrundlag — kernekapital | Hele værdien af basiskapitalgrundlaget — kernekapital, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi). Konsoliderede strategiske kapitalinteresser er ikke omfattet. Basiskapitalgrundlag — kernekapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler. |
| C0060 | Supplerende kernekapital | Hele værdien af den supplerende kernekapital, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi). Konsoliderede strategiske kapitalinteresser er ikke omfattet. Supplerende kernekapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler. |
| C0070 | Supplerende kapital | Hele værdien af den supplerende kapital, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, som individuelt overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi). Konsoliderede strategiske kapitalinteresser er ikke omfattet. Supplerende kapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler. |

Tabel 2 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), v) og vi), eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser, med henblik på fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35

| | | |
|-------|----------------------------|---|
| C0080 | Navn på tilknyttet selskab | <p>Navnet på det tilknyttede selskab, hvori kapitalinteressen besiddes.</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser.</p> |
|-------|----------------------------|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------------|--|
| C0090 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0100 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0090 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0110 | I alt | <p>Den samlede værdi, som besiddes i kapitalinteressen (endnu ikke fradragsbeløbet).</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser.</p> |
| C0120 | Basiskapitalgrundlag — kernekapital | <p>Beløbet for det basiskapitalgrundlag — kernekapital, som besiddes i kapitalinteressen (ikke kun fradragsbeløbet).</p> <p>Basiskapitalgrundlag — kernekapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler.</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|---|
| C0130 | Supplerende kernekapital | <p>Beløbet for de supplerende kernekapitalelementer, som besiddes i kapitalinteressen (ikke kun fradragsbeløbet).</p> <p>Supplerende kernekapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler.</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser.</p> |
| C0140 | Supplerende kapital | <p>Beløbet for den supplerende kapital, som besiddes i kapitalinteressen.</p> <p>Supplerende kapital har den betydning, som defineres i de relevante sektorregler (ikke kun fradragsbeløbet).</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som samlet overstiger 10 % af de elementer, der er omfattet af artikel 69, litra a), nr. i), ii), iv) og vi), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive konsoliderede strategiske kapitalinteresser.</p> |

Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, og for hvilke der er fradrag i kapitalgrundlaget

| | | |
|-----------------------------------|---|---|
| R0001/C0150 | Samlede kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — i alt | Den samlede værdi af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter (for hvilke der er fradrag i kapitalgrundlaget). |
| R0001/C0160 | Samlede kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — basiskapitalgrundlag — kernekapital | Den samlede værdi af det basiskapitalgrundlag — kernekapital, som besiddes i finansierings- og kreditinstitutter (for hvilken kapitalinteresse der er fradrag i kapitalgrundlaget). |
| R0001/C0170 | Samlede kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — supplerende kernekapital | Den samlede værdi af supplerende kernekapital, som besiddes i finansierings- og kreditinstitutter (for hvilken kapitalinteresse der er fradrag i kapitalgrundlaget). |
| R0001/C0180 | Samlede kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter — supplerende kapital | Den samlede værdi af supplerende kapital, som besiddes i finansierings- og kreditinstitutter (for hvilken kapitalinteresse der er fradrag i kapitalgrundlaget). |
| <i>Frdrag i kapitalgrundlaget</i> | | |
| R0010/C0190 | Artikel 68, stk. 1-fradrag — i alt | Den samlede værdi af artikel 68, stk. 1-fradraget, jf. delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0010/C0200 | Artikel 68, stk. 1-fradrag — kernekapital ubegrænset | Den værdi af artikel 68, stk. 1-fradraget, som fratrækkes det ubegrænsede kernekapitalelement i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0010/C0210 | Artikel 68, stk. 1-fradrag — kernekapital begrænset | Den værdi af artikel 68, stk. 1-fradraget, som fratrækkes begrænsede kernekapitalelementer i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0010/C0220 | Artikel 68, stk. 1-fradrag — supplerende kapital | Den værdi af artikel 68, stk. 1-fradraget, som fratrækkes supplerende kapitalelementer i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0020/C0190 | Artikel 68, stk. 2-fradrag — i alt | Den samlede værdi af artikel 68, stk. 2-fradraget, jf. delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0020/C0200 | Artikel 68, stk. 2-fradrag — kernekapital ubegrænset | Den værdi af artikel 68, stk. 2-fradraget, som fratrækkes det ubegrænsede kernekapitalelement i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0020/C0210 | Artikel 68, stk. 2-fradrag — kernekapital begrænset | Den værdi af artikel 68, stk. 2-fradraget, som fratrækkes det begrænsede kernekapitalelement i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0020/C0220 | Artikel 68, stk. 2-fradrag — supplerende kapital | Den værdi af artikel 68, stk. 2-fradraget, som fratrækkes supplerende kapitalelementer i henhold til artikel 68, stk. 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0030/C0190 | Sum af fradrag | Den samlede sum af alle fradrag for kapitalinteresser i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 |
| R0030/C0200 | Samlede fradrag — kernekapital ubegrænset | Den samlede sum af alle fradrag for kapitalinteresser for ubegrænset kernekapital i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0030/C0210 | Samlede fradrag — kernekapital begrænset | Den samlede sum af alle fradrag for kapitalinteresser for begrænset kernekapital i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0030/C0220 | Samlede fradrag — supplerende kapital | Den samlede sum af alle fradrag for kapitalinteresser for supplerende kapital i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Tabel 3 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interesserne betragtes som strategiske som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 (intet fradrag i kapitalgrundlaget, jf. artikel 68, stk. 3).

| | | |
|-------|----------------------------|---|
| C0230 | Navn på tilknyttet selskab | Navnet på det tilknyttede selskab, hvori kapitalinteressen besiddes. Der er tale om kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, hvor det om interesserne gælder, at disse betragtes som strategiske som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og at den er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1. |
| C0240 | Aktiv-ID-kode | Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0250 | Aktiv-ID-kodetype | ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|---|
| | | <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0240 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0260 | I alt | Den samlede værdi for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor interessen betragtes som strategisk, som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1. |
| C0270 | Type 1-aktier | <p>Beløbet for type 1-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og at den er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1.</p> <p>Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0280 | Type 2-aktier | <p>Beløbet for type 2-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og at den er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1.</p> <p>Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0290 | Efterstillet gæld | Beløbet for efterstillet gæld, som besiddes i hver kapitalinteresse i finansierings- og kreditinstitutter, hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35, og at den er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Tabel 4 — Kapitalinteresser, der besiddes i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, og som er strategiske (som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35), ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2. (Heri medregnes den resterende del (den del af kapitalinteressen, der ikke blev fratrukket) efter det delvise fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35).

| | | |
|-------|----------------------------|--|
| C0300 | Navn på tilknyttet selskab | Navnet på det tilknyttede selskab, som er et finansierings- eller kreditinstitut, hvori kapitalinteressen besiddes. Kapitalinteresserne i disse tilknyttede selskaber er strategiske (som defineret i artikel 171 i delegeret forordning (EU) 2015/35), ikke omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 og fratrækkes ikke i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2. |
| C0310 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0320 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------|---|
| | | Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0310 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvide til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«. |
| C0330 | I alt | <p>Den samlede værdi for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital af hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen er strategisk og ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1 og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de strategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0340 | Type 1-aktier | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen er strategisk, ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i type 1-aktier, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de strategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. <p>Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0350 | Type 2-aktier | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen er strategisk, ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i type 2-aktier, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|--|
| | | <p>2) den resterende del af de strategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0360 | Efterstillet gæld | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen er strategisk, ikke er omfattet af beregningen af koncernsolvens på grundlag af metode 1, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i efterstillet gæld, dvs. summen af:</p> <p>1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 %</p> <p>2) den resterende del af de strategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |

Tabel 5 — Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interesserne ikke er strategiske og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.

(Heri medregnes den resterende del efter det delvise fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35).

| | | |
|-------|----------------------------|--|
| C0370 | Navn på tilknyttet selskab | Navnet på det tilknyttede selskab, som er et finansierings- eller kreditinstitut, hvori kapitalinteressen besiddes. Kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, hvor det om interesserne gælder, at disse ikke er strategiske og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0380 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0390 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------|---|
| | | <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0380 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0400 | I alt | <p>Den samlede værdi for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital af hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen ikke er strategisk og ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af ikkestrategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de ikkestrategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0410 | Type 1-aktier | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen ikke er strategisk, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i type 1-aktier, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de ikkestrategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. <p>Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|---|
| C0420 | Type 2-aktier | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen ikke er strategisk, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i type 2-aktier, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de ikkestrategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. <p>Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0430 | Efterstillet gæld | <p>Beløbet for hver kapitalinteresse i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, hvor interessen ikke er strategisk, ikke fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35 og besiddes i efterstillet gæld, dvs. summen af:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) værdien af strategiske kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter, som hverken fratrækkes i henhold til artikel 68, stk. 1, eller artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35, fordi summen af kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter er mindre end 10 % 2) den resterende del af de ikkestrategiske kapitalinteresser efter fradrag i henhold til artikel 68, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Tabel 6 — Andre strategiske kapitalinteresser, ikke i finansierings- og kreditinstitutter

| | | |
|-------|----------------------------|--|
| C0440 | Navn på tilknyttet selskab | <p>Navnet på det tilknyttede selskab, hvori kapitalinteressen besiddes.</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser, som ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og som betragtes som strategiske.</p> |
| C0450 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|---|
| C0460 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0450 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0470 | I alt | Den samlede værdi, som besiddes for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor interessen betragtes som strategisk. |
| C0480 | Type 1-aktier | <p>Beløbet for type 1-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk.</p> <p>Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0490 | Type 2-aktier | <p>Beløbet for type 2-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk.</p> <p>Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0500 | Efterstillet gæld | Beløbet for efterstillet gæld, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den betragtes som strategisk. |

Tabel 7 — Andre ikkestrategiske kapitalinteresser, ikke i finansierings- og kreditinstitutter

| | | |
|-------|----------------------------|--|
| C0510 | Navn på tilknyttet selskab | <p>Navnet på det tilknyttede selskab, hvori kapitalinteressen besiddes.</p> <p>Der er tale om kapitalinteresser, som ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og som ikke betragtes som strategiske.</p> |
|-------|----------------------------|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|--|
| C0520 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0530 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0520 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0540 | I alt | <p>Den samlede værdi, som besiddes for kernekapital, supplerende kapital og resterende supplerende kapital i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor interessen ikke betragtes som strategisk.</p> |
| C0550 | Type 1-aktier | <p>Beløbet for type 1-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den ikke betragtes som strategisk.</p> <p>Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------------------|--|---|
| C0560 | Type 2-aktier | Beløbet for type 2-aktier, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den ikke betragtes som strategisk. Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0570 | Efterstillet gæld | Beløbet for efterstillet gæld, som besiddes i hver kapitalinteresse, der ikke er i finansierings- og kreditinstitutter, og hvor det om interessen gælder, at den ikke betragtes som strategisk. |
| <i>Sum for solvenskapitalkrav</i> | | |
| R0040/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter — i alt | Den samlede værdi af kapitalinteresser i selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0040/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter — type 1-aktier | Den samlede værdi af type 1-aktier i kapitalinteresser i selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0040/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter — type 2-aktier | Den samlede værdi af type 2-aktier i kapitalinteresser i selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0040/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter — efterstillet gæld | Den samlede værdi af efterstillet gæld i kapitalinteresser i selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0050/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf strategiske interesser (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1) — i alt | Den samlede værdi af strategiske kapitalinteresser i selskaber (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1), som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0050/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf strategiske interesser (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1) — type 1-aktier | Den samlede værdi af type 1-aktier i strategiske kapitalinteresser i selskaber (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1), som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0050/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf strategiske interesser (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1) — type 2-aktier | Den samlede værdi af type 2-aktier i strategiske kapitalinteresser i selskaber (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1), som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0050/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf strategiske interesser (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1) — efterstillet gæld | Den samlede værdi af efterstillet gæld i strategiske kapitalinteresser i selskaber (metode 1 eller mindre end 10 % ikke metode 1), som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0060/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf ikkestrategiske interesser (mindre end 10 %) — i alt | Den samlede værdi af ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber (mindre end 10 %), som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0060/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf ikkestrategiske interesser (mindre end 10 %) — type 1-aktier | Den samlede værdi af type 1-aktier i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber (mindre end 10 % — C0500), som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0060/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf ikkestrategiske interesser (mindre end 10 %) — type 2-aktier | Den samlede værdi af type 2-aktier i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber (mindre end 10 %), som er finansierings- og kreditinstitutter. Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0060/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som er finansierings- og kreditinstitutter, heraf ikkestrategiske interesser (mindre end 10 %) — efterstillet gæld | Den samlede værdi af efterstillet gæld i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber (mindre end 10 %), som er finansierings- og kreditinstitutter. |
| R0070/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — i alt | Den samlede værdi af kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0470 og C0540. |
| R0070/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 1-aktier | Den samlede værdi af type 1-aktier, som besiddes i kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Summen af C0480 og C550. |
| R0070/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 2-aktier | Den samlede værdi af type 2-aktier, som besiddes i kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Type 2-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Summen af C0490 og C0560. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0070/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — efterstillet gæld | Den samlede værdi af efterstillet gæld, som besiddes i kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0500 og C0570. |
| R0080/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — i alt — heraf strategiske interesser | Den samlede værdi af strategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0470. |
| R0080/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 1-aktier — heraf strategiske interesser | Den samlede værdi af type 1-aktier, som besiddes i strategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Summen af C0480. |
| R0080/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 2-aktier — heraf strategiske interesser | Den samlede værdi af type 2-aktier, som besiddes i strategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0490. |
| R0080/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — efterstillet gæld — heraf strategiske interesser | Den samlede værdi af efterstillet gæld, som besiddes i strategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0500. |
| R0090/C0580 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — i alt — heraf ikke-strategiske interesser | Den samlede værdi af ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0540. |
| R0090/C0590 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 1-aktier — heraf ikkestrategiske interesser | Den samlede værdi af type 1-aktier, som besiddes i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Type 1-aktier har den betydning, som defineres i artikel 168, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Summen af C0550. |
| R0090/C0600 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — type 2-aktier — heraf ikkestrategiske interesser | Den samlede værdi af type 2-aktier, som besiddes i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0560. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------|---|---|
| R0090/C0610 | Samlede kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter — efterstillet gæld — heraf ikkestrategiske interesser | Den samlede værdi af efterstillet gæld, som besiddes i ikkestrategiske kapitalinteresser i selskaber, som ikke er finansierings- og kreditinstitutter. Summen af C0570. |
| <i>I alt</i> | | |
| C0620 | Samlet for alle kapitalinteresser | Den samlede værdi for alle kapitalinteresser. |

S.25.01 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender standardformlen

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.25.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i skema S.01.03.

Såfremt en enhed har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav (»nSCR«) for risikomoduler samt de forsikringsmæssige hensættelser og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- Såfremt selskabet anvender fuld justering som følge af sammenlægningen for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav, som om der ikke forekom tab ved diversifikation, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikodelmoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav ved en direkte sammenlægning for delmoduler, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav ved en direkte sammenlægning for moduler, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0050) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici, skadesforsikringsrisici). Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

— Calculation of q factor = $\frac{\text{adjustment}}{\text{BSCR}' - \text{nSCR}_{\text{int}}}$, hvor

— *justering* = justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder

— *BSCR'* = primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema (C0040/R0100)

— *nSCR_{int}* = teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema (C0040/R0070).

- Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici, skadesforsikringsrisici).

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| Z0010 | Artikel 112 | <p>Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, i direktiv 2009/138/EF med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7</p> <p>2 — Regelmæssig indberetning</p> |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer.</p> |
| R0010–R0050/ C0030 | Nettosolvenskapitalkrav | <p>Nettokapitalkravet for hvert risikomodul beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Forskellen mellem netto- og bruttosolvenskapitalkravet er indregningen af fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I disse celler medregnes fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> |
| R0010–R0050/ C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav | <p>Bruttokapitalkravet for hvert risikomodul beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Forskellen mellem netto- og bruttosolvenskapitalkravet er indregningen af fremtidige diskretionære ydelser, som fastsat i artikel 206 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som fastsat i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I disse celler medregnes fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> |
| R0010–R0050/ C0050 | Fordeling af justering som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer — ring-fenced fonde | <p>En del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0060/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — diversifikation | <p>Det beløb, som afspejler diversifikationseffekter mellem bruttorisikomodulers primære solvenskapitalkrav, herunder diversifikationseffekter i hvert risikomodul, som følge af anvendelsen af den i bilag IV til direktiv 2009/138/EF definerede korrelationsmatrix.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> |
| R0060/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Diversifikation | <p>Det beløb, som afspejler diversifikationseffekter mellem bruttorisikomodulers primære solvenskapitalkrav, herunder diversifikationseffekter i hvert risikomodul, som følge af anvendelsen af den i bilag IV til direktiv 2009/138/EF definerede korrelationsmatrix.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> |
| R0070/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — risici på immaterielle aktiver | <p>Kapitalkravet for risici på immaterielle aktiver efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen.</p> |
| R0070/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Risici på immaterielle aktiver | <p>De fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35, for risici på immaterielle aktiver er nul efter standardformlen, hvorfor R0070/C0040 er lig med R0070/C0030.</p> |
| R0100/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — primært solvenskapitalkrav | <p>Det primære kapitalkrav efter indregning af fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 206 i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Beløbet skal i givet fald fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som omhandlet i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>I denne celle er fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau ikke medregnet. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> <p>Beløbet beregnes som summen af nettokapitalkravene for hvert risikomodul i standardformlen inklusive justering for diversifikationseffekter i standardformlen.</p> |
| R0100/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Primært solvenskapitalkrav | <p>Det primære kapitalkrav før indregning af fremtidige diskretionære ydelser jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som fastsat i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I denne celle er fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau ikke medregnet. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> <p>Beløbet beregnes som summen af bruttokapitalkravene for hvert risikomodul i standardformlen inklusive justering for diversifikationseffekter i standardformlen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| <i>Beregning af solvenskapitalkravet</i> | | |
| R0120/C0100 | Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Justeringer, der skal rette op på skævheder i beregningen af solvenskapitalkravet som følge af aggregering af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på risikomodulniveau. Beløbet skal være positivt. |
| R0130/C0100 | Operationelle risici | Kapitalkravet for modulet for operationelle risici beregnet ved brug af standardformlen. |
| R0140/C0100 | Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | <p>Justeringen for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> <p>For ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og for enheden, såfremt der hverken forekommer ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) eller matchtilpasningsporteføljer, er dette størsteværdien af nul og det beløb, der svarer til mindsteværdien af de forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring og forskellen mellem det primære brutto- og nettosolvenskapitalkrav.</p> <p>Såfremt der forekommer ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) eller matchtilpasningsporteføljer, beregnes dette beløb som summen af de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del og med de fremtidige diskretionære nettoydelse som øvre grænse.</p> |
| R0150/C0100 | Udskudte skatters tabsabsorberende evne | <p>Justeringen for udskudte skatters tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Beløbet skal være negativt.</p> |
| R0160/C0100 | Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | Kapitalkravet, beregnet i henhold til reglerne i artikel 17 i direktiv 2003/41/EF, for ring-fenced fonde vedrørende pensionsaktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF, for hvilke der gælder overgangsforanstaltninger. Posten skal kun indberettes i overgangsperioden. |
| R0200/C0100 | Solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg | Det samlede diversificerede solvenskapitalkrav før kapitaltillæg. |
| R0210/C0100 | Allerede indførte kapitaltillæg | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0211/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, litra a), pr. referencedato for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0212/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, litra b), frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0213/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, litra c), frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0214/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, litra d), frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0220/C0100 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkravet. |
| <i>Andre oplysninger om solvenskapitalkravet</i> | | |
| R0400/C0100 | Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | Kapitalkravet for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici. |
| R0410/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | De teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del, såfremt selskabet har ring-fenced fonde. |
| R0420/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle ring-fenced fonde, såfremt selskabet har ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som vedrører aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF (overgangsforanstaltninger)). |
| R0430/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle matchtilpasningsporteføljer. |
| R0440/C0100 | Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | Justeringen for en diversifikationseffekt mellem ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, og den resterende del, hvis det er relevant. |
| R0450/C0100 | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Fuldstændig genberegning 2 — Forenkling på risikodelmodulniveau 3 — Forenkling på risikomodulniveau 4 — Ingen justering Såfremt selskabet ikke har ring-fenced fonde (eller kun har ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF), vælger det mulighed 4. |
| R0460/C0100 | Fremtidige diskretionære nettoydelse | De forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring. |
| <i>Tilgang til skattesats</i> | | |
| R0590/C0109 | Tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ja 2 — Nej |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|---|
| | | <p>3 — Finder ikke anvendelse, da justeringen for de udskudte skatters tabsabsorberende evne (LAC DT) ikke anvendes (i dette tilfælde finder R0600-R0690 ikke anvendelse)</p> <p>Se EIOPA's Retningslinjer for de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne (EIOPA-BoS-14/177)</p> |

Beregning af justeringen for udskudte skatters tabsabsorberende evne

| | | |
|-------------|---|---|
| R0600/C0110 | Udskudte skatteaktiver før stød | Det samlede beløb for de udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for de udskudte skatter i denne celle skal stemme overens med værdien i cellen R0040/C0010 i S.02.01. |
| R0600/C0120 | Udskudte skatteaktiver efter stød | Det samlede beløb for de udskudte skatteaktiver, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0610/C0110 | Udskudte skatter overført — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II, som skyldes fremførsel af tidligere tab eller skatenedsættelser før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0610/C0120 | Udskudte skatter overført — Efter stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver, som skyldes fremførsel af tidligere tab eller skatenedsættelser, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0620/C0110 | Udskudte skatter som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II, som skyldes forskelle mellem værdiansættelsen i henhold til Solvens II af et aktiv eller et passiv og skattegrundlaget før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0620/C0120 | Udskudte skatter som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle — Efter stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver, som skyldes forskelle mellem værdiansættelsen i henhold til Solvens II af et aktiv eller et passiv og skattegrundlaget, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0630/C0110 | DLT — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteforpligtelser (DTL) i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for DLT i denne celle skal stemme overens med værdien i cellen R0780/C0010 i S.02.01. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0630/C0120 | DLT — Efter stød | Beløbet for de udskudte skatteforpligtelser (DLT), hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke i tilfælde af en tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats, og hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0640/C0130 | LAC DT | Beløbet for de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for den tabsabsorberende evne i denne celle skal svare til værdien i cellen R0150/C0100 i S.25.01.01. |
| R0650/C0130 | LAC DT, begrundet i udskudte skatteforpligtelser | Beløbet for de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet i hjemfald af udskudte skatteforpligtelser. |
| R0660/C0130 | LAC DT, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud | Beløbet for de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud. |
| R0670/C0130 | LAC DT, begrundet i tilbageførsel, indeværende år | Beløbet for de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, på grundlag af de tidligere års fortjeneste. Tab allokeret til næste år. |
| R0680/C0130 | LAC DT, begrundet i tilbageførsel, kommende år | Beløbet for de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, på grundlag af de tidligere års fortjeneste. Tab allokeret til årene efter næste år. |
| R0690/C0130 | Maksimum for LAC DT | Maximum for udskudte skatters tabsabsorberende evne, som kunne foreligge inden vurderingen af, hvorvidt stigningen i udskudte nettoskatteaktiver kan anvendes med henblik på justeringen, som omhandlet i artikel 207, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.25.05 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder., ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del, når der anvendes en intern model til beregning af solvenskapitalkravet.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringselskaberne.

Formålet med dette skema er at indsamle data på aggregeret niveau og vise diversificeringsfordelene mellem separate risikomoduler. Alle værdier indberettes inden den skattemæssige virkning, medmindre andet er anført.

Partielle interne modeller:

Alle rækker for C0010 henviser til kapitalkravet for hver komponent uanset beregningsmetode (enten standardformel eller partiel intern model) efter justeringer for forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne, i det omfang de er indeholdt i beregningen af komponenterne.

For komponenterne forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne bør den tabsabsorberende evne anføres, når disse offentliggøres som særskilte komponenter (disse beløb bør offentliggøres som negative beløb).

For komponenter beregnet ved brug af standardformlen anføres i denne celle det teoretiske bruttosolvenskapitalkrav. For komponenter beregnet ved brug af den partielle interne model anføres her den værdi, som indregner fremtidige ledelseshandlinger indeholdt i beregningen, men ikke sådanne, som modelleres som en særskilt komponent.

Beløbene skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.

I givet fald medregnes i disse felter ikke fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af de teoretiske solvenskapitalkrav på enhedsniveau for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer.

Skema SR.25.05 indberettes for ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del for hvert selskab under en intern model. For partielle interne modeller omfatter dette selskaber, hvor en partiel intern model anvendes på en ring-fenced fond og/eller matchtilpasningsportefølje i sin helhed, mens de øvrige ring-fenced fonde og/eller matchtilpasningsporteføljer anvender standardformlen. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

For sådanne selskaber under en partiel intern model, hvor justering som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer er relevant i tilfælde, hvor enheden har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav for risikomoduler samt de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- Såfremt selskabet anvender den fulde justering som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau: De teoretiske solvenskapitalkrav beregnes, som om der ikke var ring-fenced fonde, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af den tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og resterende del.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikodelmoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for delmoduler.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for moduler.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0050) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici), når den beregnes efter standardformlen. Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

— Beregning af »q – faktor« = $\frac{\text{justering}}{BSCR' - nSCR_{int}}$, hvor

— *justering* = justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder

— *BSCR'* = primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema

— *nSCR_{int}* = teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema

— Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici).

Komplette interne modeller:

Skema SR 25.05 udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del for hvert selskab under en komplet intern model. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| Aggregering | | |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. Hvis post Z0020 = 2, indberet »0«. |
| C0010/R0020 | Samlet beløb for diversifikation | Beløbet for diversifikationseffekter mellem risikomoduler Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0030 | Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | Værdien af diversificeret kapitalkrav før skat. Det samme som S.26.08.01 C0010/R0030 |
| C0010/R0040 | Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | Værdien af diversificeret kapitalkrav efter skat. Det samme som S.26.08.01 C0010/R0040 |
| C0010/R0070 | Samlet markeds- og kreditrisiko | Summen af de respektive følgende værdier fra C0020 i S.26.09.01: — Diversificeret renterisici (R0050) — Inflationsrisiko (R0080) — Diversificeret aktierisici (R0100) — Ejendomsrisiko (R0130) — Valutarisiko (R0140) — Summen af kreditrisici (R0150) Det samme som S.26.08.01 C0010/R0070 |
| C0010/R0080 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0080 |
| C0010/R0190 | Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0190 |
| C0010/R0200 | Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0200 |
| C0010/R0270 | Samlet virksomhedsrisiko | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0270 |
| C0010/R0280 | Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0280 |
| C0010/R0310 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0310 |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0010/R0320 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0320 |
| C0010/R0400 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0400 |
| C0010/R0410 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0410 |
| C0010/R0480 | Samlet operationel risiko | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0480 |
| C0010/R0490 | Samlet operationel risiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0490 |
| C0010/R0500 | Andre risici | Det samme som S.26.08.01 C0010/R0500 |
| C0050/R0020-R0530 | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, en del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt. |
| C0060/R0020-R0530 | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | <p>Med henblik på at angive, hvorvidt de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i beregningen, anvendes følgende udtømmende liste af valgmuligheder:</p> <p>1 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten</p> <p>2 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten</p> <p>3 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten</p> <p>4 — Ingen indeholdt indregning af fremtidige ledelseshandlinger.</p> |
| C0070/R0020-R0530 | Modelleret beløb | For hver komponent anføres i denne celle beløbet som beregnet ved brug af den partielle interne model. |
| R0110/C0100 | Ikkediversificerede komponenter i alt | Summen af alle komponenter. |
| R0060/C0100 | Diversifikation | <p>Det samlede beløb vedrørende diversifikationen mellem komponenter, jf. C0030. Beløbet indeholder ikke diversifikationseffekter inden for hver komponent, som skal være indeholdt i de i C0030 indberettede beløb.</p> <p>Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0120/C0100 | Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, den justering på risikomodul-niveau, der skal korrigere for bias i beregningen af solvenskapitalkravet som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |
| R0160/C0100 | Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | Kapitalkravet, beregnet i henhold til reglerne i artikel 17 i direktiv 2003/41/EF, for ring-fenced fonde vedrørende pensionsaktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF, for hvilke der gælder overgangsforanstaltninger. Posten skal kun indberettes i overgangsperioden. |
| R0200/C0100 | Solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg | Det samlede diversificerede solvenskapitalkrav før kapitaltillæg. |
| R0210/C0100 | Allerede indførte kapitaltillæg | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0211/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0212/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0213/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0214/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | Kapitaltillæg indført af den nationale tilsynsmyndighed frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for oplysningernes afsendelse til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0220/C0100 | Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav inklusive kapitaltillæg |

Andre oplysninger om solvenskapitalkravet

| | | |
|-------------|--|---|
| R0300/C0100 | Beløb/skøn vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | Beløb/skøn vedrørende den samlede justering for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne, heri medregnet den del, der er indeholdt i komponenterne, og den del, der offentliggøres som en særskilt komponent. Beløbet indberettes som en negativ værdi. |
| R0310/C0100 | Beløb/skøn vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne | Beløb/skøn vedrørende den samlede justering for udskudte skatter, heri medregnet den del, der er indeholdt i komponenterne, og den del, der offentliggøres som en særskilt komponent. Beløbet indberettes som en negativ værdi. |
| R0400/C0100 | Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | Beløbet for kapitalkravet for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0410/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | De teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del, såfremt selskabet har ring-fenced fonde. |
| R0420/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle ring-fenced fonde, såfremt selskabet har ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som vedrører aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF (overgangsforanstaltninger)). |
| R0430/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle matchtilpasningsporteføljer. Denne post indberettes ikke ved indberetning af solvenskravsregninger for ring-fenced fonde eller matchtilpasningsporteføljer. |
| R0440/C0100 | Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | Justeringen for en diversifikationseffekt mellem ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, og den resterende del, hvis det er relevant. Beløbet skal svare til forskellen mellem summen af det teoretiske solvenskapitalkrav for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/den resterende del og det i R0200/C0100 indberettede solvenskapitalkrav. |
| R0450/C0100 | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde. En af følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Fuldstændig genberegning 2 — Forenkling på risikodelmodulniveau 3 — Forenkling på risikomodulniveau 4 — Ingen justering Såfremt selskabet ikke har ring-fenced fonde (eller kun har ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF), vælger det mulighed 4. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |
| R0460/C0100 | Fremtidige diskretionære nettoydelse | De forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring. |

Tilgang til skattesats, hvis den beregnes ved brug af standardformlen

| | | |
|-------------|--|---|
| R0590/C0109 | Tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ja 2 — Nej 3 — Finder ikke anvendelse, da justeringen for de udskudte skatters tabsabsorberende evne (LAC DT) ikke anvendes (i dette tilfælde finder R0600-R0690 ikke anvendelse) Se EIOPA's Retningslinjer for de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne. |
|-------------|--|---|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|--|---|--|
| Beregning af justeringen for udskudte skatters tabsabsorberende evne, hvis beregnet ved brug af standardformlen. | | |
| R0600/C0110 | Udskudte skatteaktiver før stød | De samlede udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for de udskudte skatter i denne celle skal stemme overens med værdien i cellen R0040/C0010 i S.02.01. |
| R0600/C0120 | Udskudte skatteaktiver efter stød | Det samlede beløb/skøn vedrørende de udskudte skatteaktiver, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0610/C0110 | Udskudte skatter overført — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II, som skyldes fremførsel af tidligere tab eller skat-tenedsættelser før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0610/C0120 | Udskudte skatter overført — Efter stød | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatteaktiver, som skyldes fremførsel af tidligere tab eller skat-tenedsættelser, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0620/C0110 | Udskudte skatter som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteaktiver i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II, som skyldes forskelle mellem værdiansættelsen i henhold til Solvens II af et aktiv eller et passiv og dets skattegrundlag før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0620/C0120 | Udskudte skatter som følge af fradragsberettigede midlertidige forskelle — Efter stød | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatteaktiver, som skyldes forskelle mellem værdiansættelsen i henhold til Solvens II af et aktiv eller et passiv og dets skattegrundlag, hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke, hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |
| R0630/C0110 | DLT — Før stød | Beløbet for de udskudte skatteforpligtelser (DLT) i balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II før det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for DLT i denne celle skal stemme overens med værdien i cellen R0780/C0010 i S.02.01. |
| R0630/C0120 | DLT — Efter stød | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatteforpligtelser (DLT), hvis balancen under anvendelse af værdiansættelsen i henhold til Solvens II blev udarbejdet efter det umiddelbare tab, som omhandlet i artikel 207, stk. 1 og 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne celle udfyldes ikke i tilfælde af en tilgang baseret på den gennemsnitlige skattesats, og hvis der i R0590/C0109 står »1-ja«. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0640/C0130 | Beløb/skøn vedrørende LAC DT | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløbet for den tabsabsorberende evne i denne celle skal svare til værdien i cellen R0310/C0100 i S.25.05.01. |
| R0650/C0130 | Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i hjemfald af udskudte skatteforpligtelser | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet i hjemfald af udskudte skatteforpligtelser. |
| R0660/C0130 | Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet med henvisning til sandsynlige fremtidige skattepligtige overskud. |
| R0670/C0130 | Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i tilbageførsel, indeværende år | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet i de tidligere års fortjeneste. Tab allokeret til næste år. |
| R0680/C0130 | Beløb/skøn vedrørende LAC DT, begrundet i tilbageførsel, kommende år | Beløb/skøn vedrørende de udskudte skatters tabsabsorberende evne, beregnet i overensstemmelse med artikel 207 i delegeret forordning (EU) 2015/35, begrundet i de tidligere års fortjeneste fra tidligere års tab, der er allokeret til årene efter næste år. |
| R0690/C0130 | Beløb/skøn vedrørende maksimum LAC DT | Maximum for udskudte skatters tabsabsorberende evne, som kunne foreligge inden vurderingen af, hvorvidt stigningen i udskudte nettoskatteaktiver kan anvendes med henblik på justeringen, som omhandlet i artikel 207, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.26.01 — Solvenskapitalkrav — Markedsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.01.01 udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal værdien af forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0012/C0010 | Forenklinger — Kreditspændrisici på obligationer og lån | Valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 104 2 — Forenklinger med henblik på artikel 105a 9 — Forenklinger ikke anvendt Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt. Hvis R0012/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0410. |
| R0014/C0010 | Forenklinger — Markedskoncentrationsrisici — forenklinger anvendt | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forenklinger med henblik på artikel 105a 9 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0020/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — Renterisici | Angiv, hvorvidt et captive-selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af renterisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100–R0120. |
| R0030/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — Kreditspændrisici på obligationer og lån | Angiv, hvorvidt et captive-selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af kreditspændrisici på obligationer og lån. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0040/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — markedskoncentrationsrisici | Angiv, hvorvidt et captive-selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af markedskoncentrationsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | Renterisici | |
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Renterisici | Nettokapitalkravet for renterisici, dvs. efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for renterisici opgjort ved hjælp af forenklede beregninger for captive-selskaber. |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — renterisici | Bruttokapitalkravet for renterisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for renterisici opgjort ved hjælp af forenklede beregninger for captive-selskaber. |
| R0110–R0120/ C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Renterisici — Stød i form af rentefald/-stigning | Den samlede værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for renterisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0110–R0120/ C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Renterisici — Stød i form af rentefald/-stigning | Den samlede værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0110–R0120/ C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0110–R0120/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0110–R0120/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | Nettokapitalkravet for renterisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for renterisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0110–R0120/ C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for renterisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| R0110-R0120/ C0080 | Absolut værdi efter stød — bruttosolvenskapitalkrav — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | Bruttokapitalkravet for renterisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for renterisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| <i>Aktierisici</i> | | |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici | Nettokapitalkravet for aktierisici, dvs. efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici | Bruttokapitalkravet for aktierisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0210/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0210/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0210/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — aktierisici — type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0210/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0210/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 1-aktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (for type 1-aktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------------------|--|---|
| R0210/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0210/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 1-aktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici for type 1-aktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0221, R0230, R0231, R0240/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 1-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0221, R0230, R0231, R0240/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 1-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0250/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0250/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — aktierisici — type 2-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0250/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (for type 2-aktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 2-aktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (for type 2-aktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------------------|---|---|
| R0250/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (for type 2-aktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 2-aktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici for type 2-aktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0261, R0270, R0271, R0280/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 2-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0261, R0270, R0271, R0280/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Den absolutte værdi efter aktiestød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 2-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0020, R0293-R0295/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0291/C0040, R0293-R0295/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------------------|---|---|
| R0291/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0291/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0291/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0292/C0020, R0296-R0298/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0292/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0292/C0040, R0296-R0298/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0292/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0292/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| R0292/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0292/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| <i>Ejendomsrisici</i> | | |
| R0300/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Ejendomsrisici | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for ejendomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — ejendomsrisici | Værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød af de aktiver, som er følsomme over for ejendomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Ejendomsrisici | Nettokapitalkravet for ejendomsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0300/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Ejendomsrisici | Bruttokapitalkravet for ejendomsrisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | Kreditspændsrisici | |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændsrisici — obligationer og lån | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændsrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0410/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændsrisici — obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — Obligationer og lån | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, angiver denne post nettosolvenskapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0410/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — Obligationer og lån | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, angiver denne post bruttosolvenskapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0412/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0412/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0412/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0412/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0412/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke. |
| R0412/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0412/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke.</p> |
| R0413/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0413/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, udfyldes kun R0410.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0413/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0413/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0413/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0413/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0413/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke. |
| R0414/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0414/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0414/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0414/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| R0414/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke. |
| R0414/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0414/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1, indberettes denne post ikke. |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — Kreditderivater | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici for kreditderivater efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — Kreditderivater | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici for kreditderivater, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430–R0440/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændsrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændsrisici for kreditderivater. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430–R0440/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — kreditspændsrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændsrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430–R0440/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændsrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændsrisici for kreditderivater. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| R0430-R0440/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430-R0440/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Nettokapitalkravet for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430-R0440/ C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430-R0440/ C0080 | Absolutte værdier efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Bruttokapitalkravet for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0450/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0450/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0450/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0450/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0450/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0450/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0450/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0461/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0461/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 vil kunne udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0461/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0461/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | | <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0461/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0461/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0461/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0462/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0462/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0462/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0462/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0462/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0462/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0462/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0480/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuritisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0480/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringspositioner.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0480/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuring | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuringpositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0480/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuring | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuringpositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0480/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuring | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på resecuringpositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0480/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuring | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuringpositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0480/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuring | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på resecuringpositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0481/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0481/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0481/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0481/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Anden securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0481/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0481/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0481/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0482/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0482/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0482/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændsrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0482/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændsrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændsrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0482/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændsrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændsrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. |
| R0482/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændsrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændsrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0482/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændsrisici — Securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændsrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. |
| R0483/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændsrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0483/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0483/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0483/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0483/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0483/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0483/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen af solvenskapitalkravet for kreditspændrisici. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | Koncentrationsrisiko | |
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — markeds koncentrationsrisici | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for markeds koncentrationsrisici. For captive-selskaber gælder det, at hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post den absolutte værdi af de aktiver, der er følsomme over for markeds koncentrationsrisici, efter hensyntagen til de forenklinger, der er tilladt for captive-selskaber. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Koncentrationsrisici | Nettokapitalkravet for markeds koncentrationsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne, sammenlagt for hver enkelt-navnseksponeering. For captive-selskaber gælder det, at hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for markeds koncentrationsrisici opgjort ved hjælp af forenkledede beregninger. |
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Markeds koncentrationsrisici | Bruttokapitalkravet for markeds koncentrationsrisici, sammenlagt for hver enkelt-navnseksponeering, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| | Valutarisici | |
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici | Summen for de forskellige valutaer af: — kapitalkravet (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for en stigning i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta — kapitalkravet (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for et fald i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Valutarisici | Summen for de forskellige valutaer af: — kapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for en stigning i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta — kapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for et fald i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta. |
| R0610–R0620/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den samlede værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for valutarisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0610–R0620/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den samlede værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| R0610–R0620/ C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for valutarisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0610–R0620/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0610–R0620/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici — Stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Nettokapitalkravet for valutarisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. I R0610 indberettes kun de valutaer, for hvilke stødet ved stigning er størst, og i R0620 kun de valutaer, for hvilke stødet ved fald er størst. |
| R0610–R0620/ C0070 | Absolutte værdier efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0610–R0620/ C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici — Stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Bruttokapitalkravet for valutarisici, dvs. eksklusive de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. I R0610 indberettes kun de valutaer, for hvilke stødet ved stigning er størst, og i R0620 kun de valutaer, for hvilke stødet ved fald er størst. |

Diversifikation inden for markedsrisikomodulet

| | | |
|-------------|---|---|
| R0700/C0060 | Diversifikation inden for markedsrisikomodulet — nettosolvenskapitalkrav | Diversifikationseffekten inden for markedsrisikomodulet som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen indberettes som en negativ værdi, når den mindsker kapitalkravet. |
| R0700/C0080 | Diversifikation inden for markedsrisikomodulet — bruttosolvenskapitalkrav | Diversifikationseffekten inden for markedsrisikomodulet som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen indberettes som en negativ værdi, når den mindsker kapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| <i>Samlet solvenskapitalkrav for markedsrisiko</i> | | |
| R0800/C0060 | Samlet markedsrisiko — nettosolvenskapitalkrav | Det samlede nettokapitalkrav for alle markedsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. |
| R0800/C0080 | Samlet markedsrisiko — bruttosolvenskapitalkrav | Det samlede bruttokapitalkrav for alle markedsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. |

S.26.02 — Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.02.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0010/C0010 | Forenklinger | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af modpartsrisici. Valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 3 — Forenkling — puljeaftaler, med henblik på artikel 109 4 — Forenkling af gruppering af enkeltnavnseksponeringer, med henblik på artikel 110 5 — Forenkling af tab givet misligholdelse for genforsikringsaftaler, artikel 112a |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | | <p>6 — Forenkling for type 1-eksponeringer, artikel 112b</p> <p>7 — Forenkling for genforsikringsaftalers risikoreducerende virkning, artikel 111</p> <p>9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 3 til 7 kan anvendes samtidigt.</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 4 eller 6, for type 1-eksponeringer, udfyldes kun R0100/C0080 med henblik på R0100.</p> |
| R0100/C0080 | Type 1-eksponeringer — bruttosolvenskapitalkrav | <p>Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for modpartsrisici hidrørende fra type 1-eksponeringer.</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 4 eller 6, angiver denne post bruttosolvenskapitalkravet ved anvendelse af forenklinger.</p> |
| R0110–R0200/C0020 | Enkeltnavnseksponering | Angiv navnene på de ti største enkelte eksponeringer. |
| R0110–R0200/C0030 | Kode for enkeltnavnseksponering | <p>Angiv identifikationskoden ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> |
| R0110–R0200/C0040 | Kodetype for enkeltnavnseksponering | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Kode for enkeltnavnseksponering«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> |
| R0110–R0200/C0050 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — tab givet misligholdelse | Værdien af tab givet misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| R0110–R0200/C0060 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| R0300/C0080 | Type 2-eksponeringer — bruttosolvenskapitalkrav | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for modpartsrisici hidrørende fra type 2-eksponeringer som defineret med henblik på Solvens II. |
| R0310/C0050 | Type 2-eksponeringer — tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for type 2-modpartrisici hidrørende fra tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder. |
| R0320/C0050 | Type 2-eksponeringer — alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder — tab givet misligholdelse — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for type 2-modpartrisici hidrørende fra alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0330/C0080 | Diversifikation inden for modulet for modpartsrisici — bruttosolvenskapitalkrav | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved sammenlægningen af kapitalkrav for modpartsrisici hidrørende fra type 1- og type 2-eksponeringer. |
| R0400/C0070 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for modpartsrisici | Det samlede nettokapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelses tabsabsorberende evne) for modpartsrisici. |
| R0400/C0080 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for modpartsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelses tabsabsorberende evne) for modpartsrisici. |

Nærmere oplysninger om realkreditlån

| | | |
|-------------|---------------------------------------|--|
| R0500/C0090 | Tab som følge af type 2-realkreditlån | Samlet tab som følge af realkreditlån, der er klassificeret som type 2-eksponeringer, i henhold til artikel 191, stk. 13, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0510/C0090 | Samlet tab som følge af realkreditlån | Samlet tab som følge af realkreditlån, i henhold til artikel 191, stk. 13, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.03.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal værdien af forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0010/C0010 | Anvendte forenklinger: dødelighedsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af dødelighedsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100. |
| R0020/C0010 | Forenklinger anvendt — levetidsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af levetidsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0200. |
| R0030/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0300. |
| R0040/C0010 | Anvendte forenklinger: optionsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 95 2 — Forenkling med henblik på artikel 95a 9 — Forenklinger ikke anvendt Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt. Hvis R0040/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0400-R0420. |
| R0050/C0010 | Anvendte forenklinger: omkostningsrisici for livsforsikringer | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af omkostningsrisici for livsforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0050/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0500. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0060/C0010 | Anvendte forenklinger: livsforsikringskatastroferisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af livsforsikringskatastroferisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0060/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0700.</p> |

Livsforsikringsrisiko

| | | |
|-------------|--|--|
| R0100/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0100/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |
| R0100/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0100/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici | <p>Nettokapitalkravet for dødelighedsrisici efter stød (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne).</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for dødelighedsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger.</p> |
| R0100/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici | <p>Bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici. (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne)</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0200/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — levetidsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — levetidsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for levetidsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici | Nettokapitalkravet for levetidsrisici efter stød (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for levetidsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0200/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici | Bruttokapitalkravet for levetidsrisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for levetidsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0300/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici, en stigning i invaliditets- og sygdomsintensiteten, som benyttes til beregning af forsikringsmæssige hensættelser for at afspejle invaliditets- og sygdomserfaringerne i de efterfølgende 12 måneder og for alle måneder efter de efterfølgende 12 måneder samt et fald i helbredelsesprocenterne for invaliditet og sygdom, som benyttes til beregning af forsikringsmæssige hensættelser for de efterfølgende 12 måneder og alle efterfølgende år. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0300/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0300/C0040) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici | Bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for optionsrisici, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for optionsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for optionsrisici. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for optionsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0040 | Oprindelige absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten opgjort ved hjælp af forenkede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0410/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — risici for stigning i optionsintensiteten) | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten opgjort ved hjælp af forenkede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0420/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0420/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten opgjort ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0420/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten) | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Bruttokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten opgjort ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0430/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0430/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Nettokapitalkravet for masseoptionsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — optionsrisici — masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Bruttokapitalkravet for masseoptionsrisici efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). |
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer: En stigning på 10 % i de udgifter, som tages i betragtning ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser, samt en stigning på ét procentpoint i den udgifts-inflationsrate (udtrykt i procent), som anvendes ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0500/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0500/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for livsforsikringer | Nettokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer inklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger. |
| R0500/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0500/C0040) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for livsforsikringer | Bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger. |
| R0600/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. en procentvis stigning i annuitetsydelse, der er anvendt i beregningen af forsikringsmæssige hensættelser Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. definitionen i celle R0600/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici | Nettokapitalkravet for genoptagelsesrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0600/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensæt- telsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. definitionen i celle R0600/C0040) af de forpligtelser (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for genoptagelsesrisici. |
| R0700/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — livsfor- sikringskatastroferisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0700/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0700/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — livsforsikringskata- stroferisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0700/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensæt- telsers tabsabsorberende evne) — livsforsikringskatastroferi- sici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0700/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Livsforsikringskatastroferisici | Nettokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici opgjort ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0700/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensæt- telsers tabsabsorberende evne) — livsforsikringskatastroferi- sici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0700/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Livsforsikringskatastroferisici | Bruttokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici opgjort ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0800/C0060 | Diversifikation inden for modulet for livsforsikringsrisici — netto | Diversifikationseffekten inden for modulet for livsforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0800/C0080 | Diversifikation inden for modulet for livsforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for modulet for livsforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0900/C0060 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for livsforsikringsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for livsforsikringsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0900/C0080 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for livsforsikringsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav for livsforsikringsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici

| | | |
|-------------|---|--|
| R1000/C0090 | Selskabsspecifikke parametre — Anvendte faktorer ved stød for genoptagelsesrisici | Stød i forbindelse med genoptagelse — selskabsspecifikke parametre som beregnet af selskabet og godkendt af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
|-------------|---|--|

S.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.04.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal værdien af forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0010 | Artikel 112 | <p>Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7</p> <p>2 — Regelmæssig indberetning</p> |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer.</p> |
| R0010/C0010 | Forenklinger anvendt — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100.</p> |
| R0020/C0010 | Forenklinger anvendt — levetidsrisici for sygeforsikringer | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af levetidsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0200.</p> |
| R0030/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes kun C0060/R0310 og C0080/R0310. R0320 og R0330 udfyldes ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0040/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0040/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0340. |
| R0050/C0010 | Anvendte forenklinger: SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 102 2 — Forenkling med henblik på artikel 102a 9 — Forenklinger ikke anvendt Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt. Hvis R0050/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0400-R0420. |
| R0051/C0010 | Forenklinger — Optionsrisici for NSLT-sygeforsikring | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 96a 9 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0060/C0010 | Anvendte forenklinger: Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af omkostningsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0060/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0500. |

SLT-sygeforsikringsrisici

| | | |
|-------------|---|---|
| R0100/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0100/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0100/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0100/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0200/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0200/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for levetidsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer. |
| R0310/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0310/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0320/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0320/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0330/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Fald i udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0340/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0340/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0340/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0340/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer. |
| R0410/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Bruttokapitalkravet (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten, opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0420/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — risici for fald i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensitet for SLT-sygeforsikringer. |
| R0420/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — risici for fald i optionsintensiteten | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, opgjort ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0430/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Nettokapitalkravet for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — masseoptionsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Bruttokapitalkrav (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0500/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer opgjort ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0500/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for omkostningsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer opgjort ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0600/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0600/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, en %-stigning i det årlige beløb, som skal betales for annuiteter eksponeret mod genoptagelsesrisici) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. |
| R0700/C0060 | Diversifikation inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici — netto | Diversifikationseffekten inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodemoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0700/C0080 | Diversifikation inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodemoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0800/C0060 | Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for forsikringsrisici for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0800/C0080 | Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav for forsikringsrisici for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici

| | | |
|-------------|--|--|
| R0900/C0090 | Stød i forbindelse med genoptagelse — Selskabsspecifikke parametre | Stød i forbindelse med genoptagelse — selskabsspecifikke parametre som beregnet af selskabet og godkendt af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
|-------------|--|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|---|
| <i>Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring</i> | | |
| R1000–R1030/ C0100 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre | Selskabets specifikke standardafvigelser for præmierisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dets proportionale genforsikring som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
| R1000–R1030/ C0110 | Standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre, brutto/netto | Angiv, om standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre er anvendt brutto eller netto. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Selskabsspecifikke parametre, brutto 2 — Selskabsspecifikke parametre, netto |
| R1000–R1030/ C0120 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre — justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Den selskabsspecifikke justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, som gør det muligt for selskaber at tage hensyn til den risikoreducerende virkning af særlig skadesexcedentgenforsikring pr. risiko — som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Hvis der ikke anvendes specifikke parametre, udfyldes denne celle ikke. |
| R1000–R1030/ C0130 | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici — selskabsspecifikke parametre | Selskabets specifikke standardafvigelser for erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dets proportionale genforsikring som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
| R1000–R1030/ C0140 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for præmierisici: Vprem | Mængdeangivelsen for præmierisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1000–R1030/ C0150 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for erstatningshensættelsesrisici: Vres | Mængdeangivelsen for erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1000–R1030/ C0160 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — Geografisk diversifikation | Den geografiske diversifikation, der skal anvendes til mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. Hvis faktoren for geografisk diversifikation ikke beregnes, fastsættes denne post til standardværdien 1. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| R1000–R1030/ C0170 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — V | Mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 og 12, i delegeret forordning (EU) 2015/35, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1040/C0170 | Samlet mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | Den samlede mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko er lig med summen af mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko for alle brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R1050/C0100 | Kombineret standardafvigelse | Den kombinerede standardafvigelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for alle segmenter. |
| R1100/C0180 | Solvenskapitalkrav — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | Det samlede kapitalkrav for delmodulet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 og 12, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R1200/C0190 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R1200/C0200 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R1200/C0210 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R1200/C0220 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser, som er følsomme over for optionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R1200/C0230 | Absolut værdi efter stød — Solvenskapitalkrav — Optionsrisici | Kapitalkravet for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R1300/C0240 | Diversifikation inden for NSLT-sygeforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet for NSLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af kapitalkravene præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring og NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R1400/C0240 | Samlet solvenskapitalkrav for NSLT-sygeforsikring | Det samlede kapitalkrav for delmodulet for NSLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Sygeforsikringskatastroferisici

| | | |
|-------------|--|---|
| R1500/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — delmodulet for masseulykkesrisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for masseulykkesrisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1500/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — delmodulet for masseulykkesrisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for masseulykkesrisici beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1510/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — ulykkeskoncentrationsrisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for ulykkeskoncentrationsrisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1510/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — ulykkeskoncentrationsrisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for ulykkeskoncentrationsrisici beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1520/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — pandemirisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1520/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — pandemirisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for pandemirisici beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1530/C0250 | Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici — netto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for masseulykkesrisici, ulykkeskoncentrationsrisici og pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1530/C0260 | Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for masseulykkesrisici, ulykkeskoncentrationsrisici og pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1540/C0250 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede nettokapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R1540/C0260 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede bruttokapitalkrav for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). |

De samlede sygeforsikringsrisici

| | | |
|-------------|---|---|
| R1600/C0270 | Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet — netto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for delmodulet SLT-sygeforsikringsrisici, delmodulet NSLT-sygeforsikringsrisici og delmodulet sygeforsikringskatastroferisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1600/C0280 | Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for delmodulet SLT-sygeforsikringsrisici, delmodulet NSLT-sygeforsikringsrisici og delmodulet sygeforsikringskatastroferisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1700/C0270 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici | Det samlede nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisikomodulet. |
| R1700/C0280 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici | Det samlede bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisikomodulet. |

S.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.05.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal værdien af forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0010/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | Angiv, hvorvidt et captive-selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060, C0070 og C0090 udfyldes med henblik på R0100-R0230. |
| R0011/C0010 | Anvendte forenklinger — skadesforsikringsoptionsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af skadesforsikringsrisikoen. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 90a 9 — Forenkling ikke anvendt |

Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer

| | | |
|-----------------------|---|---|
| R0100–R0210/ C0020 | Standardafvigelse for præmierisici — standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre | Selskabets specifikke standardafvigelser for præmierisici for hvert segment som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
| R0100–R0210/ C0030 | Standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre, brutto/netto | Angiv, om standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre er anvendt brutto eller netto. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Selskabsspecifikke parametre, brutto 2 — Selskabsspecifikke parametre, netto |
| R0100–R0210/ C0040 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre — justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring | Den selskabsspecifikke justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring for hvert segment, som gør det muligt for selskaber at tage hensyn til den risikoreducerende virkning af særlig skadesexcedentgenforsikring pr. risiko — som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| R0100–R0210/ C0050 | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici — selskabsspecifikke parametre | Selskabets specifikke standardafvigelser for erstatningshensættelsesrisici for hvert segment som beregnet af selskabet og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes selskabsspecifikke parametre. |
| R0100–R0210/ C0060 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for præmierisici: Vprem | Mængdeangivelsen for præmierisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0100–R0210/ C0070 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for erstatningshensættelsesrisici: Vres | Mængdeangivelsen for erstatningshensættelsesrisici lig med det bedste skøn over hensættelserne til udestående krav for segmentet efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er. |
| R0100–R0210/ C0080 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — Geografisk diversifikation — | Den geografiske diversifikation, der er anvendt til mængdeangivelsen for hvert segment. Hvis faktoren for geografisk diversifikation ikke beregnes, fastsættes denne post til standardværdien 1. |
| R0100–R0210/ C0090 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — V | Mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer for hvert segment Hvis R0010/C0010 = 1, angives under denne post kapitalkravet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer for et bestemt segment beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0220/C0090 | Samlet mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | Den samlede mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko er lig med summen af mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko for alle segmenter. |
| R0230/C0020 | Kombineret standardafvigelse | Den kombinerede standardafvigelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for alle segmenter. |
| R0300/C0100 | Det samlede solvenskapitalkrav for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | Det samlede solvenskapitalkrav for delmodulet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer. |

Skadesforsikringsoptionsrisici

| | | |
|-------------|--|---|
| R0400/C0110 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0400/C0120 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0400/C0130 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0400/C0140 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0400/C0150 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Kapitalkravet for skadesforsikringsoptionsrisici. |

Skadesforsikringskatastroferisici

| | | |
|-------------|--|--|
| R0500/C0160 | Solvenskapitalkrav for skadesforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav for skadesforsikringskatastroferisici. |
|-------------|--|--|

De samlede skadesforsikringsrisici

| | | |
|-------------|--|---|
| R0600/C0160 | Diversifikation inden for skadesforsikringsrisikomodulet | Diversifikationseffekten inden for delmodulet skadesforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for præmie- og erstatningshensættelsesrisici, katastroferisici og optionsrisici. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0700/C0160 | Det samlede kapitalkrav for skadesforsikringsrisici | Solvenskapitalkravet for delmodulet for skadesforsikringsrisici. |

S.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.06.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0100/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser (eksklusive risikomargin) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked. I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0110/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for unit-linked livsforsikring (undtagen risikomargin) | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for livsforsikringsforpligtelser, hvor forsikringstagere bærer investeringsrisikoen I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0120/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for skadesforsikring (undtagen risikomargin) | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikringsforpligtelser. I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0130/C0020 | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser. | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0200/C0020 | Bruttopræmieindtægter (foregående 12 måneder) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0210/C0020 | Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne, uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0220/C0020 | Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for skadesforsikringsforpligtelser uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0230/C0020 | Bruttopræmieindtægter (12 måneder forud for de foregående 12 måneder) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0240/C0020 | Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne, uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0250/C0020 | Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for skadesforsikringsforpligtelser uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0260/C0020 | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter |
| R0300/C0020 | Kapitalkrav til dækning af operationelle risici før anvendelse af loft | Kapitalkravet for operationelle risici før anvendelse af loft. |
| R0310/C0020 | Loft baseret på det primære solvenskapitalkrav | Resultatet af den for loftet fastsatte procentdel anvendt på det primære solvenskapitalkrav. |
| R0320/C0020 | Kapitalkrav til dækning af operationelle risici efter anvendelse af loft | Kapitalkravet for operationelle risici efter anvendelse af loft. |
| R0330/C0020 | Udgifter i forbindelse med unit linked virksomhed (seneste 12 måneder) | De udgifter, der er påløbet i de seneste 12 måneder med hensyn til livsforsikring, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne. |
| R0340/C0020 | Samlet kapitalkrav for operationelle risici | Kapitalkravet for operationelle risici |

S.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Skema SR.26.07.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| Z0040 | Valuta for renterisici (captive-selskaber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen. Hver valuta skal indberettes i hver sin række |

Markedsrisici (herunder captive-selskaber)

| | | |
|-------------------|---|---|
| R0010/C0010–C0070 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — markedsværdi — efter kreditkvalitetstrin | Markedsværdien af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån for hvert kreditkvalitetstrin, hvor der foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0010/C0080 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Markedsværdi — Der foreligger ingen vurdering | Markedsværdien af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån, hvor der ikke foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0020/C0010–C0070 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Modifieret varighed — Efter kreditkvalitetstrin | Den modificerede varighed i år af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån for hvert kreditkvalitetstrin, hvor der foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0020/C0080 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Modifieret varighed — Der foreligger ingen vurdering | Den modificerede varighed i år af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån, hvor der ikke foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0030/C0090 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — stigning i unit-linked og indeksregulerede forsikringsmæssige hensættelser | Stigningen i de forsikringsmæssige hensættelser med fradrag af risikomargin for de policer, hvor forsikringstagerne bærer investeringsrisikoen med indlejrede optioner og garantier, som ville følge af et umiddelbart fald i værdien af de aktiver, som er underlagt kapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer, ifølge den forenkede beregning. |

Renterisici (captive-selskaber)

| | | |
|-------------|--|--|
| R0040/C0100 | Renterisici (captive-selskaber) — kapitalkrav — rentestigning — efter valuta | Kapitalkravet for risikoen for en stigning i rentekurven ifølge den forenkede beregning for captive-selskaber for hver indberettet valuta. |
| R0040/C0110 | Renterisici (captive-selskaber) — kapitalkrav — rentefald — efter valuta | Kapitalkravet for risikoen for et fald i rentekurven ifølge den forenkede beregning for captive-selskaber for hver indberettet valuta. |

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------------|---|--|
| <i>Livsforsikringsrisiko</i> | | |
| R0100/C0120 | Dødelighedsrisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 91 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af dødelighedsrisici. |
| R0100/C0160 | Dødelighedsrisici — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t +1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0100/C0180 | Dødelighedsrisici — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved dødsfald, og som medtages i det bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0110/C0150 | Levetidsrisici — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af levetidsrisici. |
| R0110/C0160 | Levetidsrisici — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t + 1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0110/C0180 | Levetidsrisici — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger til begunstigede, som medtages i det bedste skøn for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0120/C0120 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 93 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |
| R0120/C0130 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Risikosum t+1 | Risikosum som defineret i R0120/C0120 efter 12 (t + 1) måneder. |
| R0120/C0150 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |
| R0120/C0160 | Invaliditets- og sygdomsrisici — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+1 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de efterfølgende 12 (t + 1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0170 | Invaliditets- og sygdomsrisici — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+2 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de 12 måneder efter de efterfølgende 12 (t+2) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Modificeret varighed | Modificeret varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved invaliditet og sygdom, og som medtages i bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0200 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Opsigelsesprocent | Den forventede opsigelsesprocent i de efterfølgende 12 måneder for policer med en positiv risikosum. |
| R0130/C0140 | Optionsrisici (stigning) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle positive genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 95 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0130/C0160 | Optionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig optionsintensitet (t+1) | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med positive genkøbspåvirkninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0130/C0190 | Optionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med positive genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0140/C0140 | Optionsrisici (fald) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle negative genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 95 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0140/C0160 | Optionsrisici (fald) — Gennemsnitlig optionsintensitet (t+1) | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med negative genkøbspåvirkninger. |
| R0140/C0190 | Optionsrisici (fald) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med negative genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0150/C0180 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i bedste skøn over livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser. |
| R0150/C0210 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Betalinger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med livsforsikring og livs-genforsikring i de seneste 12 måneder. |
| R0150/C0220 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter, der indgår i beregningen af det bedste skøn, til honorering af eksisterende livsforsikringsforpligtelser. |
| R0160/C0120 | Livsforsikringskatastroferisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 96 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Sygeforsikringsrisiko

| | | |
|-------------|--|--|
| R0200/C0120 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 97 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af dødelighedsrisici for sygeforsikringer. |
| R0200/C0160 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t + 1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0200/C0180 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved dødsfald, og som medtages i det bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0210/C0150 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af levetidsrisici for sygeforsikringer. |
| R0210/C0160 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t + 1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0210/C0180 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger til begunstigede, som medtages i det bedste skøn for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0220/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0220/C0210 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Betalinger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling i de seneste 12 måneder. |
| R0220/C0220 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation for udgifter til lægebehandling, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter til lægebehandling, der indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser. |
| R0230/C0120 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 100 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici (indkomstsikring). |
| R0230/C0130 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Risikosum t +1 | Risikosum som defineret i R0230/C0120 efter 12 måneder. |
| R0230/C0150 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |
| R0230/C0160 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+1 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de efterfølgende 12 (t + 1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0170 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+2 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de 12 måneder efter de efterfølgende 12 (t + 2) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Modifieret varighed | Modifieret varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved invaliditet og sygdom, og som medtages i bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0200 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Opsigelsesprocent | Den forventede opsigelsesprocent i de efterfølgende 12 måneder for policer med en positiv risikosum. |
| R0240/C0140 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (stigning) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle positive genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 102 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0240/C0160 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (stigning) — gennemsnitlig optionsintensitet t+1 | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med positive genkøbspåvirkninger. |
| R0240/C0190 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med positive genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0250/C0140 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (fald) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle negative genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 102 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0250/C0160 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (fald) — gennemsnitlig optionsintensitet t+1 | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med negative genkøbspåvirkninger. |
| R0250/C0190 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (fald) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med negative genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0260/C0180 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i det bedste skøn over sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| R0260/C0210 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Betalinger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med sygeforsikring og sygegenforsikring i de seneste 12 måneder. |
| R0260/C0220 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter, der indgår i beregningen af bedste skøn over eksisterende sygeforsikringsforpligtelser. |

Markedsrisici — Markedskoncentrationsrisici

| | | |
|----------------------|---|--|
| R0300/C0300 | Gældsporteføljeandel | Den gældsporteføljeandel, for hvilken der blev foretaget en forenklet beregning af solvenskapitalkravet. Denne post indberettes kun i tilfælde af fritagelsen for indberetning i S.06.02. |
| NAT CAT-forenklinger | | |
| R0400/C0330 | Storm — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — storm |
| R0410/C0330 | Hagl — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — hagl |
| R0420/C0330 | Jordskælv — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — jordskælv |
| R0430/C0330 | Oversvømmelse — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — oversvømmelse |
| R0440/C0330 | Jordskred — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — jordskred |

S.26.08 — Solvenskapitalkrav — for selskaber, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

Formålet med dette skema er at indsamle data på aggregeret niveau og vise diversificeringsfordelene mellem separate risikomoduler. Nogle poster stammer fra andre skemaer, men er anført nedenfor. Set ud fra et teknisk perspektiv er disse ikke kopieret, da de i alt væsentligt er de samme datapunkter. Således fremkommer de automatisk i et skema, når de udfyldes i et andet skema.

Partielle interne modeller:

Alle rækker for C0010 henviser til kapitalkravet for hver komponent uanset beregningsmetode (enten standardformel eller partiel intern model) efter justeringer for forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne, i det omfang de er indeholdt i beregningen af komponenterne.

For komponenterne forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne bør den tabsabsorberende evne anføres, når disse offentliggøres som særskilte komponenter (disse beløb bør offentliggøres som negative beløb).

For komponenter beregnet ved brug af standardformlen anføres i denne celle det teoretiske bruttosolvenskapitalkrav. For komponenter beregnet ved brug af den partielle interne model anføres her den værdi, som indregner fremtidige ledelseshandlinger indeholdt i beregningen, men ikke sådanne, som modelleres som en særskilt komponent.

Beløbene skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.

I givet fald medregnes i disse felter ikke fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af de teoretiske solvenskapitalkrav på enhedsniveau for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer.

Skema SR.26.08 indberettes for ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del for hvert selskab under en intern model. For partielle interne modeller omfatter dette selskaber, hvor en partiel intern model anvendes på en ring-fenced fond og/eller matchtilpasningsportefølje i sin helhed, mens de øvrige ring-fenced fonde og/eller matchtilpasningsporteføljer anvender standardformlen. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

For sådanne selskaber under en partiel intern model, hvor justering som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer er relevant i tilfælde, hvor enheden har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav for risikomoduler samt de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- såfremt selskabet anvender den fulde justering som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau: De teoretiske solvenskapitalkrav beregnes, som om der ikke var ring-fenced fonde, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af den tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og resterende del.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for delmoduler.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for moduler.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0060) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici), når den beregnes efter standardformlen. Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

— Beregning af »q – faktor« = $\frac{\text{justering}}{BSCR' - nSCR_{int}}$, hvor

— *justering* = justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder

- $BSCR'$ = primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema
- $nSCR_{int}$ = teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema
- Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici).

Komplette interne modeller:

Skema SR 26.08 udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del for hvert selskab under en komplet intern model. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|---|---|
| <i>Aggregering</i> | | |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. Hvis post Z0020 = 2, indberet »0«. |
| C0010/R0010 | Samlede værdi for fritstående risiko | Summen af de diversificerede kapitalkrav for hvert risikomodul. Diversifikation mellem risikomoduler er ikke omfattet. $S.26.09.01 \ C0020/R0020 + S.26.11.01 \ C0110/R0210 + S.26.12.01 \ C0070/R0220 + S.26.13.01 \ C0450/R2120 + S.26.13.01 \ C0150/R1210 + S.26.14.01 \ C0320/R0630 + S.26.15.01 \ C0220/R0070 +$ den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0020 | Samlet beløb for diversifikation | Beløbet for diversifikationseffekter mellem risikomoduler Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0030 | Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | Diversificeret kapitalkrav før skat. |
| C0010/R0040 | Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | Diversificeret kapitalkrav efter skat. |
| C0010/R0050 | Udskudte skatters tabsabsorberende evne | Justering for udskudte skatters tabsabsorberende evne Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0060 | Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | Justering for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0070 | Samlet markeds- og kreditrisiko | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0010 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0080 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvor det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt markeds- og kreditrisici, ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0090 | Renterisici | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0060 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0100 | Rentevolatilitetsrisiko | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0110 | Inflationsrisiko | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0080 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0120 | Aktierisici | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0110 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0130 | Aktievolatilitetsrisiko | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0120 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0140 | Ejendomsrisici | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0130 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0150 | Valutarisici | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0140 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0160 | Kreditspændrisiko | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0180 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0170 | Kreditbegivenhedsrisici («migration og misligholdelse») | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0170 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0180 | Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | Det samme som for S.26.09.01 C0020/R0150 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0190 | Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko | Solvenskapitalkravet tildelt de kreditbegivenhedsrisici, der ikke er omfattet af modulet for markeds- og kreditrisici. |
| C0010/R0200 | Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0190 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvor det er relevant, med fradrag af diversifikationen, der er tildelt de kreditbegivenhedsrisici, som ikke er omfattet af modulet for markeds- og kreditrisici. |
| C0010/R0210 | Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | Kapitalkrav tildelt basisrisikoen ved finansielle instrumenter (risiko for ufuldstændig afdækning, summen af prisforskellene mellem aktiv og sikringsinstrument). Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0760. |
| C0010/R0220 | Risici ved derivater | Kapitalkrav tildelt risici ved derivater (alle derivater anvendes ikke til sikringsformål). Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0770. |
| C0010/R0230 | Kapitalinteresser | Kapitalkrav tildelt kapitalinteresser. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0720. |
| C0010/R0240 | Likviditetsrisiko | Kapitalkrav tildelt likviditetsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0730. |
| C0010/R0250 | Pensionsrisici | Kapitalkrav tildelt pensionsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0740. |
| C0010/R0260 | Koncentrationsrisiko | Kapitalkrav tildelt koncentrationsrisici. For selskaber, der anvender en komplet intern model, skal dette kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0750. |
| C0010/R0270 | Samlet virksomhedsrisiko | Kapitalkrav tildelt virksomhedsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model. |
| C0010/R0280 | Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0240 med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt virksomhedsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0290 | Samlet forsikringsrisiko | S.26.08.01 C0010/R0310 + S.26.08.01 C0010/R0400 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0300 | Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0290 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt forsikringsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0310 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici | Summen af S.26.08.01 C0010/R0360, R0370, R0380 + R0390 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0320 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0310 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt skadesforsikringsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0330 | Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | S.26.13.01 C0430/R1690 + S.26.13.01 C0430/R1700 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0340 | Menneskeskabte risici, opgjort netto | S.26.13.01 C0430/R1710 + S.26.13.01 C0430/R1720 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0350 | Bruttoerstatningshensættelsesrisici | Det samme som for S.26.13.01 C0050/R0090 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0360 | Bruttopræmierisici | Det samme som for S.26.13.01 C0080/R0540 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0370 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | Summen af S.26.08.01 C0010/R0420-R0480 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, eller summen af S.26.08.01 C0010/R0480-R0500 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0380 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0400 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt risici ved livs- og sygeforsikring ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0390 | Dødelighedsrisici | S.26.14.01 C0070/R0010 + S.26.14.01 C0070/R0310 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0400 | Levetidsrisici | S.26.14.01 C0070/R0050 + S.26.14.01 C0070/R0360 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0410 | Invaliditets- og sygdomsrisici | S.26.14.01 C0070/R0110 + S.26.14.01 C0070/R0410 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0010/R0420 | Genoptagelse | S.26.14.01 C0070/R0160 + S.26.14.01 C0070/R0470 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0430 | Omkostningsrisici | S.26.14.01 C0070/R0240 + S.26.14.01 C0070/R0550 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0440 | Genoptagelsesrisici | S.26.14.01 C0070/R0260 + S.26.14.01 C0070/R0570 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0450 | Katastroferisici | Det samme som for S.26.14.01 C0070/R0250 + S.26.14.01 C0070/R0560 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant eller S.26.14.01 C0070/R0300 + S.26.14.01 C0070/R0600 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, afhængig af modellens udformning. |
| C0010/R0460 | Risici i forbindelse med tendenser | Det samme som for S.26.14.01 C0070/R0280 + S.26.14.01 C0070/R0580. |
| C0010/R0470 | Risici i forbindelse med niveau | Det samme som for S.26.14.01 C0070/R0290 + S.26.14.01 C0070/R0590. |
| C0010/R0480 | Samlet operationel risiko | Det samme som for S.26.15.01 C0220/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0490 | Samlet operationel risiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0510 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt operationelle risici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0500 | Andre risici | Kapitalkrav, der ikke er tildelt de her opførte kategorier + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, |
| C0050/R0010-R0500 | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, en del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt. |
| C0060/R0010-R0500 | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Med henblik på at angive, hvorvidt de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i beregningen, anvendes følgende udtømmende liste af valgmuligheder: 1 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 2 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | | 3 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 4 — Ingen indeholdt indregning af fremtidige ledelseshandlinger. |
| C0070/R0010-R0500 | Modelleret beløb | For hver komponent anføres i denne celle beløbet som beregnet ved brug af den partielle interne model. |
| C0080/R0510 | Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | Beskrivelse af, hvad der er omfattet af kapitalkravet i C0010/R0530. |

Modellerede specifikke risici — Det er muligt med flere tilfælde af »Modelleret« i kolonnerne i hver række, hvis C0140 er »Ikke modelleret«.

| | | |
|-----------------------|--------------------------------------|--|
| R0700-R0820/ C0140 | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Modelleret 2 — Ikke modelleret Hvis svaret er »Modelleret«, henvises der til tabellen i begyndelsen af LOG-filen, hvor man kan se, hvad der skal udfyldes. Hvis svaret er »Ikke modelleret«, udfyldes C0150 til C0190 for hver række, afhængigt af hvor risikoen er dækket. Hvis det ikke er dækket, skal alle koder i samme række være »Ikke modelleret«. |
| R0700-R0770/ C0150 | Markeds- og kreditrisici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Modelleret 2 — Ikke modelleret Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for markeds- og kreditrisici. |
| R0700-R0770/ C0160 | Skadesforsikring | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Modelleret 2 — Ikke modelleret Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for skadesforsikringsrisici. |
| R0700-R0770/ C0170 | Livs- og sygeforsikringsrisici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Modelleret 2 — Ikke modelleret Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for livs- og sygeforsikringsrisici. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--------------------|--|
| R0700-R0770/ C0180 | Operationel risiko | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for operationelle risici.</p> |
| R0700-R0770/ C0190 | Andet | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i et andet risikomodulet, der ikke er omhandlet her.</p> |

S.26.09 — Intern model: Markeds- og kreditrisici — for finansielle instrumenter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringselskaberne.

Medmindre andet er anført, skal »Solvens II-værdi« udfyldes under anvendelse af værdiansættelsesprincipperne i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder udstedt i henhold til direktiv 2009/138/EF og EIOPA's retningslinjer.

Dette skema omfatter markeds- og kreditrisici, der skyldes niveauet og volatiliteten i forbindelse med markedspriserne på finansielle instrumenter, hvilket har en indvirkning på værdien af selskabets eller koncernens aktiver og forpligtelser. Kreditrisikoen dække de sædvanlige tre aspekter »spænd«, »migration« og »misligholdelse«.

Tallene skal omfatte indvirkningen på aktiver og passiver, herunder indvirkningen på optioner og garantier og på fremtidige diskretionære ydelser for forsikringstagere (»de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne«).

Tallene skal ikke omfatte de udskudte skatters tabsabsorberende evne.

Skemaet består af tre hoveddele:

1. »Generelle oplysninger« om nogle få nøgleaspekter i tilgangen til modelberegning.
2. »Fritstående kapitalkrav for markeds- og kreditrisici og supplerende data om fordeling«
3. »Data om følsomhed og eksponering«

S.26.09.01.01: Generelle oplysninger

Med hensyn til modeller for markeds- og kreditrisici kræves der her tre oplysninger om fremgangsmåde og anvendelsesområde for modelberegningen, da disse er vigtige for dataanalysen, nemlig: Hvorvidt modellen omfatter en »dynamisk volatilitetsjustering«, hvorvidt modellen omfatter »aldringseffekter«, og hvorvidt ikke-finansielle instrumenter er omfattet i kreditrisikoen. Se yderligere oplysninger nedenfor.

S.26.09.01.02: Fritstående kapitalkrav for markeds- og kreditrisici og supplerende data om fordeling

Baseret på kravene i artikel 228 i delegeret forordning (EU) 2015/35 tildeles der ved sandsynlighedsfordelingsprognosen, som ligger til grund for den interne model, sandsynligheder vedrørende ændringer enten i værdien af forsikrings- og genforsikrings-selskabets basiskapitalgrundlag eller i andre monetære beløb, f.eks. overskud og tab, under forudsætning af at disse monetære beløb kan anvendes til at fastslå ændringerne i basiskapitalgrundlaget. Det udtømmende sæt af indbyrdes udelukkende fremtidige begivenheder, som er omhandlet i artikel 13, stk. 38, i direktiv 2009/138/EF, indeholder et tilstrækkeligt antal begivenheder til at afspejle selskabets risikoprofil.

I skema S.26.09.01.02 anmodes brugere af interne modeller om at levere visse grundlæggende statistiske værdier fra fordelingen af kapitalgrundlagsindvirkninger, der har relation til »sandsynlighedsfordelingsprognosen«, når begivenheder begrænses til dem, der udelukkende forbindes med en vis type risiko (»fritstående risiko« eller »marginal risiko«) For eksempel ville den »marginale risiko« især kunne dække ændringer i rentesatsens niveau, men bl.a. værdien af aktien ville typisk ikke blive ændret i simulationerne.

S.26.09.01.02 omfatter de typiske underrisici ved markeds- og kreditrisici og kræver tal i to undergrupper:

I. »Solvenskapitalkrav«-lignende tal under hensyntagen til »langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger«, i lighed med skema S.22.01:

Disse tal bør associeres med 99,50 % VaR under den risikomåling, der blev anvendt til beregning af solvenskapitalkravet. Generelt set forventes man at anvende den modellerede »definition på solvenskapitalkrav« på basiskapitalgrundlaget uden restriktioner for anerkendelse og uden de udskudte skatters tabsabsorberende evne. Således kan det ønskede tal adskille sig fra 0,5 %-fraktilen i en selektion i forbindelse med de simulerede indvirkninger (med negativt tegn), der skyldes den statistiske estimator for 0,5-percentilen (f.eks. inklusive enhver interpolation og »udjævning«)

I forbindelse med disse indberetningskrav kaldes denne værdi for »den modellerede VaR« (mVaR) for 99,50 % af basiskapitalgrundlaget.

Denne »mVaR 99,50 %« skal angives for de følgende variationer af »langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger« (LTGM)

- o mVaR 99,50 % inklusive alle de LTGM, som anvendes regelmæssigt
- o mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser
- o mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende renter
- o mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden overgangsforanstaltninger
- o mVaR 99,50 % uden matchtilpasning (MA) og uden alle de andre LTGM'er

II. Grundlæggende statistiske data fra »marginal fordeling«

Fra fordelingen for den pågældende marginale risiko angiv indvirkninger associeret med de følgende data. Værdierne skal tages direkte fra fordelingen, dvs. hvis mVaR er forskellig fra 99,50 %-fraktilen, angives tal uden at tage højde for karakteristika for den statistiske estimator:

- o Middelværdi
- o Standardafvigelse
- o Indvirkninger svarende til mVaR for de identificerede fraktiler.

S.26.09.01.03: Data om følsomhed og eksponering

I skema S.26.09.01.03 anmodes der om data til støtte for analysen af resultater og risikoprofil, nemlig oplysninger om »følsomheder« vedrørende kapitalgrundlaget og »eksponering« for så vidt angår markeds- og kreditrisici for finansielle instrumenter.

I S.26.09.01.03 anmodes der for hver af de underrisici, der er omfattet af S.26.09.01.02, om data over eksponering i referencescenariet og i visse stressscenarier. Data over eksponering er Solvens II-værdien af de følgende poster, men kun for de angivelser under disse poster, som er underlagt den pågældende risiko.

- Aktiver
- Forpligtelser

- Aktiver minus forpligtelser
- Aktiver eksklusive unit-linked
- Forpligtelser eksklusive unit-linked
- Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

Generelle oplysninger

| | | |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Anvendt type volatilitetsjustering | <p>Angivelse af, hvorvidt selskabet anvender en volatilitetsjustering (VA) i beregningen af solvenskapitalkravet, og i tilfælde af »ja«, angives hvorvidt der forventes ændringer i VA over en etårig tidshorisont under Solvens II (»dynamisk VA«) eller ej (»konstant VA«). En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Ingen volatilitetsjustering 2 — Konstant volatilitetsjustering 3 — Dynamisk volatilitetsjustering |
| C0010/R0020 | Type chokmodel for markedsrisici | <p>For markeds- og kreditrisiko følger de interne modeller vedrørende den etårige tidshorisont i Solvens II stort set to fremgangsmåder. Momentane chokmodeller eller forventninger set over et år, ved udgangen af hvilket f.eks. en obligation med en løbetid på to år ved forventningens begyndelse vil have en løbetid på 1 år. Selskabet anmodes om at besvare spørgsmålet vedrørende »markedsrisici«.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Momentan chokmodel 2 — Projektionsmodel |
| C0010/R0030 | Type chokmodel for kreditrisici | <p>For markeds- og kreditrisiko følger de interne modeller vedrørende den etårige tidshorisont i Solvens II stort set to fremgangsmåder. Momentane chokmodeller eller forventninger set over et år, ved udgangen af hvilket f.eks. en obligation med en løbetid på to år ved forventningens begyndelse vil have en løbetid på 1 år. Svaret bør gives for »kreditrisici«.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Momentan chokmodel 2 — Projektionsmodel |
| C0010/R0040 | Dækning af ikke-finansielle instrumenter | <p>Angiver, om kreditrisici for ikke-finansielle instrumenter er dækket i tabel 2 og 3 og i hvilket omfang. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Nej 2 — Fuldstændigt 3 — Delvist <p>Valget går hovedsageligt på tilgangen i modelberegningen af risikoen vedrørende »kreditbegivenhed«, dvs. »migration« og »misligholdelse«. Særligt såkaldte »kreditporteføljemodeller« omfatter ikke bare instrumenter, men f.eks. også genforsikring, tilgodehavender og også ikkebalanceførte poster.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|--|
| | | De tilsvarende oplysninger er relevante for fortolkningen af række R12 til R17 i relation til kreditrisici i tabel 2 (»marginale risici«, S.26.09 R0150 til R0200) og i tabel 3 (»kombinerede risici«, S.26.09 R0010 til R0030). |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: DATA OM SOLVENSKAPITALKRAV OG FORDELING

| | | |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0060/ R0040 | Summen af renterisici | Summen af de respektive værdier af C0020-C0060/R0060 og C0020-C0060/R0070. |
| C0020-C0300/ R0050 | Summen af renterisiko, hvor Diversificeret renterisici | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter renterisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i rentekurven eller i renternes volatilitet. Den omfatter ikke følsomheden over for nogen af aspekterne af kreditrisikoen. Her bør der kun tages højde for diversifikation mellem ændringer i rentekurven og ændringer i volatiliteten i renterne. |
| C0020-C0300/ R0060 | Summen af renterisiko, hvor Renterisici | Denne risiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i rentekurven, men ikke ændringer i renternes volatilitet eller nogen af aspekterne af kreditrisikoen. |
| C0020-C0300/ R0070 | Summen af renterisiko, hvor Rentevolatilitetsrisiko | Denne risiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i renternes volatilitet, men ikke nogen af aspekterne af kreditrisikoen. |
| C0020-C0300/ R0080 | Inflationsrisiko | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter denne risiko følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i inflationen. Da inflation i visse interne modeller også er medregnet, f.eks. i forsikringsrisiko, bedes man sikre sig, at der ikke sker dobbelttælling. |
| C0020-C0060/ R0090 | Summen af aktierisici | Summen af de respektive værdier af C0020-C0060/R0110 og C0020-C0060/R0120. |
| C0020-C0300/ R0100 | Summen af aktierisiko, hvor Summen af aktierisici diversificeret | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter aktierisici følsomheden hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i aktiernes markedspriser. Her bør der tages højde for diversifikation mellem ændringer i omfanget af og ændringer i volatiliteten i markedspriser. |
| C0020-C0300/ R0110 | Summen af aktierisiko, hvor Aktierisici | Aktierisici omfatter følsomheden hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet i aktiernes markedspriser. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0020-C0300/ R0120 | Summen af aktierisiko, hvor Aktievolatilitetsrisiko | Aktievolatilitetsrisiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i volatiliteten i aktiernes markedspriser. |
| C0020-C0300/ R0130 | Ejendomsrisici | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter ejendomsrisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i ejendommenes markedspriser. Til forskel fra f.eks. aktierisiko kræves der ingen opdeling efter »niveau« og »volatilitet«. |
| C0020-C0300/ R0140 | Valutarisici | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter valutarisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i valutakurserne. Til forskel fra f.eks. aktierisiko kræves der ingen opdeling efter »niveau« og »volatilitet«. |
| C0020-C0060/ R0150 | Summen af kreditrisici | Summen af de respektive følgende værdier: — Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) (R0170) — Kreditspændrisici »Regeringer og centralbanker« (R0190) — Kreditspændrisici, øvrige (R0200) Hvis opdelingen i »Regeringer og centralbanker« (R0190) og »øvrige« (R0200) ikke findes i modellen, anvendes der »Kreditspændrisici« (R0180) i stedet i summen. |
| C0020-C0300/ R0160 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditrisici diversificeret | Inden for markeds- og kreditrisici omfatter kreditrisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af aktiver som følge af ændringer i kreditspændrisici, kreditmigration eller kreditmisligholdelse. Her bør der tages højde for diversifikation mellem ændringer i kreditspændrisici, kreditmigration eller kreditmisligholdelse Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster. |
| C0020-C0300/ R0170 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) | Kreditbegivenhedsrisici omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af aktiver som følge af ændringer i kreditmigration eller kreditmisligholdelse. Der bør tages højde for diversifikation mellem kreditmigration og kreditmisligholdelse Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0020-C0300/ R0180 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditspændrisiko | Kreditspændrisici omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter som følge af ændringer i spænd i forbindelse med den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes kreditmigration eller (delvis) misligholdelse. |
| C0020-C0300/ R0190 | Kreditspændrisici — kredit- spændrisiko »Regeringer og centralbanker« | Kreditspændrisici, »Regeringer og centralbanker«, omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter udstedt af regeringer og centralbanker som følge af ændringer i spænd i den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes migration eller (delvis) misligholdelse. Følgende liste indeholder de CIC-koder for aktivklasser, der tildelt regeringer eller centralbanker: 13, 14, 15, 16, 17 og 19 CIC-kode 13 og 14 er blevet anvendt til at angive obligationer, der udstedes af regionale regeringer og lokale myndigheder (RGLA). RGLA bør tildeles porteføljen for statslige papirer, hvis de er opført i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, og ellers til en ikke-finansiel erhvervsportefølje afhængig af deres kreditkvalitetstrin. |
| C0020-C0300/ R0200 | Kreditspændrisiko, øvrige | Kreditspændrisici, »øvrige«, omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter, der ikke er udstedt af regeringer og centralbanker, som følge af ændringer i spænd i den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes migration eller (delvis) misligholdelse. |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: Kombineret markeds- og kreditrisiko

| | | |
|-----------------------|---|---|
| C0020-C0060/ R0020 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Her anmodes om data for den kombinerede markeds- og kreditrisiko, dvs. risici som følge af niveauet af og volatiliteten i markedspriserne på aktiver, hvilket har en indvirkning på værdien af selskabets eller koncernens aktiver og forpligtelser. Kreditrisikoen dække de sædvanlige tre aspekter »spænd«, »migration« og »misligholdelse«. Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster. |
| C0020-C0060/ R0010 | Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2-kompo- nenter) | Summen af de respektive følgende værdier: — Diversificeret renterisici (R0050) — Inflationsrisiko (R0080) — Diversificeret aktierisici (R0100) — Ejendomsrisiko (R0130) — Valutarisiko (R0140) — Summen af kreditrisici (R0150) |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0020-C0060/ R0030 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Værdi svarende til forskellen mellem C0020-C0060/R0020 og C0020-C0060/R0010. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: Data om følsomhed og eksponering

| | | |
|-----------------------|---|---|
| C0310-C0360/ R0210 | Eksponering, der er følsom over for renter, — reference-scenario/intet stød | Solvens II-værdien i Solvens II-balancen på den afgørende dag for eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt renterisici. |
| C0310-C0360/ R0220 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med - 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på - 100 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0230 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med + 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på + 100 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0240 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med - 50 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på - 50 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0250 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med + 50 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på + 50 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0260 | Eksponering, der er følsom over for inflationsrater, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i Solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt inflationsrisici. |
| C0310-C0360/ R0270 | Inflationsrater - 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt inflationsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i inflationssatsen på - 100 %. Denne følsomhed bør anvendes i tråd med definitionen i de interne modeller og tildelingen af inflationsrisiko. |
| C0310-C0360/ R0280 | Inflationsrater + 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt inflationsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i inflationssatsen på + 100 %. Denne følsomhed bør anvendes i tråd med definitionen i de interne modeller og tildelingen af inflationsrisiko. |
| C0310-C0360/ R0290 | Eksponering, der er følsom over for kreditspænd, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt kreditspændsrisici. |
| C0310-C0360/ R0300 | Spænd (ensartet forskydning — alle løbetider og aktiver) - 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt kreditspændsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet forskydning i kreditspænd på - 100 basispoint for alle løbetider og aktiver. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0310-C0360/ R0310 | Spænd (ensartet forskydning — alle løbetider og aktiver) + 100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt kreditspændrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet forskydning i kreditspænd på + 100 basispoint for alle løbetider og aktiver. |
| C0310-C0360/ R0320 | Eksponering, der er følsom over for aktiekursrisici, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt aktiekursrisici. |
| C0310-C0360/ R0330 | Aktier (ensartet forskydning i værdier) – 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt aktiekursrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i værdien på – 30 %. |
| C0310-C0360/ R0340 | Aktier (ensartet forskydning i værdier) + 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt aktiekursrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i værdien på + 30 %. |
| C0310-C0360/ R0350 | Eksponering, der er følsom over for ejendomsrisici, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt ejendomsrisici. |
| C0310-C0360/ R0360 | Ejendom (ensartet forskydning i værdier) – 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt ejendomsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i værdien på – 30 %. |
| C0310-C0360/ R0370 | Ejendom (ensartet forskydning i værdier) + 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt ejendomsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i værdien på + 30 %. |
| C0310-C0360/ R0380 | Eksponering, der er følsom over for valutarisici, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt valutarisici. |
| C0310-C0360/ R0390 | Valuta (ensartet forskydning i kurser) – 10 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt valutarisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i valutakursen på – 10 %. |
| C0310-C0360/ R0400 | Valuta (ensartet forskydning i kurser) + 10 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt valutarisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i valutakursen på + 10 %. |
| C0310-C0360/ R0410 | Eksponering, der er følsom over for rentevolatiliteten, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt rentevolatilitetsrisici. |
| C0310-C0360/ R0420 | Rentevolatilitetsrisiko, forringelse – 25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i rentevolatiliteten på – 25 %. Denne forskydning er en parallelforskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0420 eller R0430. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0310-C0360/ R0430 | Rentevolatiliteten er faldet med – 20 basispoint for normal volatilitet | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i rentevolatiliteten på – 20 % for normal volatilitet. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0420 eller R0430. |
| C0310-C0360/ R0440 | Rentevolatiliterisiko, forøgelse + 25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i rentevolatiliteten på + 25 %. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0440 eller R0450. |
| C0310-C0360/ R0450 | Rentevolatiliteten er steget med + 20 basispoint for normal volatilitet | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i rentevolatiliteten på + 20 % for normal volatilitet. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0440 eller R0450. |
| C0310-C0360/ R0460 | Eksponering, der er følsom over for aktievolatiliteten, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt aktievolatilitetsrisici. |
| C0310-C0360/ R0470 | Aktievolatiliteten er faldet med – 25 %. | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i aktievolatiliteten på – 25 %. |
| C0310-C0360/ R0480 | Aktievolatilitet, forøgelse + 25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i aktievolatiliteten på + 25 %. |

S.26.10 — Intern model: Kreditbegivenhedsrisici — porteføljeoversigt

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

I henhold til følgende data anmodes der om seks forskellige aspekter af aktivporteføljen, som er underlagt risikoen for kreditmigration og kreditmisligholdelse set ud fra et porteføljeperspektiv. Alle typer eksponeringer er omfattet, særligt investeringer og genforsikring.

De fire hovedaspekter er:

- De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav
- De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi
- Opdelt efter aktivklasser
- Opdelt efter kreditkvalitetstrin (CQS)

For så vidt angår de ti største eksponeringer, kræves der to parametre for hver enkelt:

- »gruppe«, dvs. rangorden af eksponeringer for grupper af indbyrdes forbundne modparter
- »enkelt«, dvs. fritstående modparter

Eksempel: Et selskab A har den følgende kontraktuelle forbindelse med selskaber i en forsikringskoncern G. Og A er ikke en del af koncernen G: 1) A har en genforsikringskontrakt med selskab R i koncern G, 2) A besidder andele i den indbetalte kapital for R, og 3) A har et lån, der er udstedt af et livsforsikringselskab L i koncern G i selskabets aktivportefølje. Blokkene »gruppe« vil vise de tre kombinerede eksponeringer. Blokkene »enkeltstående« vil vise disse separat: 1) og 2) kombineret for modpart R og 3) for modpart L.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav (koncernniveau)

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0010/R0030-R0120 | Navnet på koncernens eksponering | Navnene på de ti største eksponeringer for modparter (på koncernniveau) med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav. Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0020/R0010-R0130 | Markedsværdi | Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0010-R0130 | Eksponering ved misligholdelse | Eksponeringen ved misligholdelse — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0010-R0130 | Kreditrisikobidrag | Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici: — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0020-R0120 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0060/R0020-R0120 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0010-R0130 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0010-R0130 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav (enkelte eksponeringer)

| | | |
|-------------------|--------------------------------|--|
| C0090/R0160-R0250 | Eksponeringens navn | Navnene på de ti største eksponeringer blandt enkelte eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav. Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0020/R0140-R0260 | Markedsværdi | Markedsværdien i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0140-R0260 | Eksponering ved misligholdelse | Eksponeringer ved misligholdelse: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0140-R0260 | Kreditrisikobidrag | Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0150-R0250 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0150-R0250 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0140-R0260 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | <p>Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0140-R0260 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | <p>Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (koncernniveau)

| | | |
|-------------------|----------------------------------|--|
| C0010/R0290-R0380 | Navnet på koncernens eksponering | Navnene på de ti største eksponeringer for modparter (på koncernniveau) med hensyn til markedsværdi. |
| C0020/R0270-R0390 | Markedsværdi | <p>Markedsværdien i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0270-R0390 | Eksponering ved misligholdelse | <p>Eksponeringer ved misligholdelse:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0040/R0270-R0390 | Kreditrisikobidrag | Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici: — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0280-R0380 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0280-R0380 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0270-R0390 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0270-R0390 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (enkelte eksponeringer)

| | | |
|-------------------|---------------------|--|
| C0090/R0420-R0510 | Eksponeringens navn | Navnene på de ti største eksponeringer blandt enkelte eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav. Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0020/R0400-R0520 | Markedsværdi | Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0400-R0520 | Eksponering ved misligholdelse | <p>Eksponering ved misligholdelse i indberetningsvaluta</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0400-R0520 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0410-R0510 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0410-R0510 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0400-R0520 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | <p>Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0400-R0520 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | <p>Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

Opdelt efter aktivklasser

| | | |
|-------------------|--------------|--|
| C0020/R0530-R0640 | Markedsværdi | Markedsværdien i alt i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål opdelt efter aktivklasser: |
|-------------------|--------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0030/R0530-R0640 | Eksposering ved misligholdelse | Samlet eksposering ved misligholdelse opdelt efter aktivklasse. |
| C0040/R0530-R0640 | Kreditrisikobidrag | Samlet bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici (i indberetningsvalutaen), inklusive diversifikation og opdelt efter aktivklasser, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0050/R0530-R0630 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i aktivklasser: |
| C0060/R0530-R0630 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitligt tab givet misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i aktivklasser. |
| C0070/R0530-R0640 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Den samlede andel af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksposeringer for kreditbegivenhedsrisici opdelt efter aktivklasser. Ikkebalanceførte og øvrige |
| C0080/R0530-R0640 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici opdelt efter aktivklasser |

Opdelt efter kreditkvalitetstrin (CQS)

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0020/R0650-R0730 | Markedsværdi | Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål opdelt efter kreditkvalitetstrin |
| C0030/R0650-R0730 | Eksposering ved misligholdelse | Samlet eksposering ved misligholdelse i indberetningsvaluta opdelt efter kreditkvalitetstrin. |
| C0040/R0650-R0730 | Kreditrisikobidrag | Samlet bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici (i indberetningsvalutaen), inklusive diversifikation og opdelt efter kreditkvalitetstrin, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0050/R0650-R0720 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i kreditkvalitetstrin. |
| C0060/R0650-R0720 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitligt tab givet misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i kreditkvalitetstrin. |
| C0070/R0650-R0730 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Den samlede andel af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksposeringer for kreditbegivenhedsrisici opdelt efter kreditkvalitetstrin |
| C0080/R0650-R0730 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Den samlede andel af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici opdelt efter kreditkvalitetstrin. |
| C0100/R0740 | Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) – 99,5 % | Det samlede kapitalkrav for kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) for 99,5 %-fraktilen. |
| C0100/R0750 | Forventet tab — middelværdi | Den samlede middelværdi af sandsynlighedsfordelingen af de forventede tab for kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«). |

S.26.11 — Intern model: Kreditrisici — nærmere oplysninger om finansielle instrumenter*Generelle bemærkninger*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------------------|---|--|
| <i>Eksponering ved misligholdelse</i> | | |
| C0010-C0090/ R0010 | Samlet eksponering ved misligholdelse | Eksponering ved misligholdelse for forskellige kreditkvalitetstrin. |
| C0010- C0090/R0020- R0080 | Specifikation af eksponering ved misligholdelse | Eksponeringer ved misligholdelse opdelt efter forskellige aktivklasser og kreditkvalitetstrin. |

Sandsynlighed for misligholdelse — vægtet gennemsnit, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse

| | | |
|---------------------------------|---|--|
| R0100 | Den samlede sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for forskellige kreditkvalitetstrin. |
| C0010- C0090/R0110- R0170 | Specifikation af sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse opdelt efter forskellige aktivklasser og kreditkvalitetstrin. |
| C0100/R0180 | Beskrivelse af andet | Resumé af indholdet i kategorien »Andet« omhandlet i række R0080 og R0170 med henblik på en vurdering af væsentlighed. |

Solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------|--|---|
| C0110/R0190 | Samlet ikkediversificeret kreditrisiko | Det samlede kapitalkrav for kreditrisici inden eventuelle diversifikationseffekter. |
| C0110/R0200 | Diversifikation: kreditrisiko | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved aggregering af kapitalkrav for kreditrisici. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0110/R0210 | Diversificeret risiko: kreditrisiko | Det samlede kapitalkrav for kreditrisici. |

S.26.12 — Intern model: Kreditrisici — for ikke-finansielle instrumenter*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| <i>Type 1-eksponering med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav</i> | | |
| C0010/R0020-R0110 | Enkeltnavnseksponering | Angiv navnene på de ti største enkelte eksponeringer. |
| C0020/R0020-R0110 | Kode for enkeltnavnseksponering | Angiv identifikationskoden ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke. |
| C0030/R0010 | Summen af alle tab givet misligholdelse | Summen af tab givet misligholdelse for alle type 1-eksponeringer. |
| C0030/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — tab givet misligholdelse | Værdien af tab givet misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0030/R0120 | Type 1, aggregeret tab givet misligholdelse, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer | Tab givet misligholdelse for alle type 1-eksponeringer, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0040/R0010 | Summen af alle eksponeringer ved misligholdelse | Summen af eksponeringer ved misligholdelse for alle type 1-eksponeringer. |
| C0040/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — eksponering ved misligholdelse | Eksponeringsværdi ved misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0040/R0120 | Type 1, aggregeret eksponering ved misligholdelse, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer | Eksponeringsværdi ved misligholdelse for alle type 1-eksponeringer, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0050/R0010 | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 1-eksponeringer | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 1-eksponeringer, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0050/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |

Type 2-eksponering med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0030/R0130 | Summen af alle tab givet misligholdelse | Summen af tab givet misligholdelse for alle type 2-eksponeringer. |
| C0030/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for forskellige eksponeringer. For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusiv R0140—R0150. For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusiv R0140—R0160. For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusiv R0140—R0170. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0030/R0190 | For Type 2-eksponeringer aggregeres tab givet misligholdelse, eksklusive R0140—R0180. | Tab givet misligholdelse for alle type 2-eksponeringer, eksklusive R0140—R0180. |
| C0040/R0130 | Summen af alle eksponeringer ved misligholdelse | Summen af eksponeringer ved misligholdelse for alle type 2-eksponeringer. |
| C0040/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — Eksponering ved misligholdelse | Eksponering ved misligholdelse for forskellige eksponeringer: For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0150. For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0160. For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0170. |
| C0040/R0190 | For Type 2 aggregeres eksponering ved misligholdelse, eksklusive R0140—R0180. | Eksponering ved misligholdelse for alle type 2-eksponeringer, eksklusive R0140—R0180. |
| C0050/R0130 | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 2-eksponeringer | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 2-eksponeringer, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0050/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — Sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver og en af R0140—R0180. For R0140 og R0150 skal det være den vægtede gennemsnitlige sandsynlighed for misligholdelse, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0060/R0140-R0180 | Beskrivelse af eksponering | Kort beskrivelse af type 2-eksponering. For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0150. For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0160. For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0170. |

Solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------|--|--|
| C0070/R0200 | Den samlede ikkediversificerede modpartsrisiko | Det samlede kapitalkrav for modpartsrisici inden eventuelle diversifikationseffekter. |
| C0070/R0210 | Diversifikation: Modpartsrisici | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved sammenlægningen af kapitalkrav for modpartsrisici hidrørende fra type 1- og type 2-eksponeringer. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0070/R0220 | Diversificeret risiko: Modpartsrisici | Det samlede kapitalkrav for modpartsrisici. |

S.26.13 — Intern model: Forsikringsrisici ved skades- og NSLT-sygeforsikring

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

Dette skema indeholder oplysninger om skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici i de følgende forskellige detaljeringsgrader med og uden fradrag af genforsikring:

- Præmie- og erstatningshensættelsesrisici: Præmie- og erstatningshensættelsesrisici, inklusive Kat.:
- Katastroferisici (Kat.): Oplysninger om katastroferisici.
- Præmie- og erstatningshensættelsesrisici (eksklusive eksplicit Kat.): Præmie- og erstatningshensættelsesrisici, eksklusive eksplicit Kat.
- Præmierisici: Fordelingen af præmierisici bør være således, at dens middelværdi afspejler et forventet overskud eller tab, herunder præmiehensættelser i løbet af året. Resultater bør ekskludere Kat.
- Erstatningshensættelsesrisici: Fordelingen af erstatningshensættelsesrisici bør være således, at dens middelværdi er på ca. nul, da der ikke forventes overskud i henhold til et bedste skøn. Resultater bør ekskludere Kat.
- Inden for præmie- og erstatningshensættelsesrisici anmodes der om de to følgende opdelinger:
 - o Solvens II-brancher (S2LoB): Som defineret i bilag II til delegeret forordning, baseret på brancher (LoB'er) som defineret i bilag I.
 - o Brancher i henhold til interne modeller (IntLoB) Det forstås som det mest detaljerede niveau fra den interne models direkte output-data, for hvilket sandsynlighedsfordelingsfunktionen for tab og solvenskapitalkrav er til rådighed. Brancher i henhold til interne modeller (IntLoB) forventes at blive anvendt til intern indberetning og til forvaltningen af selskabets kapitalpositioner. Brancher i henhold til interne modeller ligger typisk tæt op ad et parameterniveau. De gør det muligt at forstå den interne models specifikke adfærd.

Ved coassurance ved direkte forsikringsvirksomhed antages hele andelen af virksomheden for førende forsikringselskaber at skulle indberettes som direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, hvorved andelen som deles med ikke førende forsikringsvirksomheder skal anses for at være cederet genforsikring.

Generelt gælder følgende:

- Pengemæssige beløb i dette skema, medregnes ikke.
- Høje percentiler udgør negative resultater for selskabet, da den underliggende fordeling er en fordeling af tab (dvs. 99,5 anvendes til beregningen af solvenskapitalkravet).
- Generelt forventes det, at de ønskede tal findes i begge detaljeringsgrader (enten i henhold til interne modeller eller Solvens II), og at de konsekvent indberettes for hver af disse to detaljeringsgrader så vidt muligt (middelværdier, tillæg osv.)
- Begrebet *diversificeret* anvendes i dette skema til at skelne mellem forskellige detaljeringsgrader (f.eks. er diversificeret erstatningshensættelsesrisici den samlede aggregerede erstatningshensættelsesrisiko sammenlignet med summen af de udiversificerede brancher i henhold til Solvens II).

Eftersom der er forskellig måder at modelberegne disse risici på, anmodes selskaberne ikke om at ændre deres interne model med henblik på at følge kodernes struktur. Så hvis selskaber modellerer katastroferisici sammen med risici for præmier og/eller erstatningshensættelser, skal de ikke udfylde afsnittet med »Fordeling af tab fra katastroferisici«. Dertil kommer, at hvis selskaber opnår en specifik fordeling af præmie og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring og en separat fordeling for skadesforsikringsrisici, uden at aggregere de to, så vil oplysningerne indgå i afsnittene »Samlet NSLT-sygeforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet NSLT-sygeforsikring med fradrag af genforsikring«, hhv. afsnittene »Samlet skadesforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet skadesforsikring med fradrag af genforsikring«. I modsat fald bør »Samlet skadesforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet skadesforsikring med fradrag af genforsikring« ikke indberettes.

Begivenheden OEP (Occurrence Exceedance Probability) er den sandsynlighed, at det dermed forbundne tabsniveau vil blive overskredet med enhver begivenhed i ethvert år. Den anvendes, når forsikringsprogrammet tegnes på grundlag af begivenheder, eller når tabet forbundet med en begivenhed er stort.

Begivenheden AEP (Aggregate Exceedance Probability) er den sandsynlighed, at det dermed forbundne tabsniveau vil blive overskredet med det aggregerede tab i et givet år, og anvendes, når forsikringsprogrammet tegner på aggregeret basis.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------------------|--|--|
| Risikomodelldata | | |
| C0010/R0010 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for præmierisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Solvenskapitalkravet måles som afvigelsen fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0020. Nej — Solvenskapitalkravet måles som afvigelsen fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0020.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0020.</p> |
| C0010/R0020 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for præmierisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for præmierisici i henhold til den interne model (f.eks. af den »økonomiske« overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det parameter, der er defineret for solvenskapitalkravet i artikel 101 i Solvens II-direktivet, og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder den risikomåling, der er defineret i artikel 101 i Solvens II-direktivet, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model, jf. artikel 101 i Solvens II-direktivet«</p> |
| C0010/R0030 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for erstatningshensættelsesrisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> <p>Nej — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> |
| C0010/R0040 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for erstatningshensættelsesrisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for erstatningshensættelsesrisici i henhold til den interne model (f.eks. af den økonomiske overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det standardparameter, der er anvendt for solvenskapitalkravet i Solvens II-direktivets afsnit 4, underafsnit 1 og 2, (med særlig fokus på artikel 101, 104, 105 og 108), og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, going concern osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder alle antagelser i afsnit 4, underafsnit 2, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model i tråd med definitionen af risikomåling ved standardformler«</p> |
| C0010/R0050 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for katastroferisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | <p>Nej — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> |
| C0010/R0060 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for katastroferisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for katastroferisici i henhold til den interne model. (f.eks. af den økonomiske overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det standardparameter, der er anvendt for solvenskapitalkravet i Solvens II-direktivets afsnit 4, underafsnit 1 og 2, (med særlig fokus på artikel 101, 104, 105 og 108), og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, going concern osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder alle antagelser i afsnit 4, underafsnit 2, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model i tråd med definitionen af risikomåling ved standardformler«</p> |

Matchning af interne brancher

| | | |
|-------|-----------------------------------|--|
| C0020 | Intern branche | Navnet på intern branche anvendt i den interne model. Det skal være konsekvent i hele skemaet. |
| C0030 | Branche i henhold til Solvens II. | <p>Navnet på den branche inden for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, der indberettes. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> <p>Det forventes, at forsikrings- og genforsikringselskaber angiver, i hvilken Solvens II-branche den interne branche indgår.</p> <p>Hvis en intern branche matcher to eller flere Solvens II-brancher, indberettes der i C0040 den tilsvarende andel (som en værdi mellem 0 og 1) af den interne branche for hver af de matchede Solvens II-brancher. Disse værdier skal tilsammen give 1 for hver intern branche, der matcher to eller flere Solvens II-brancher. Hvis der er en matchning på en til en, anføres der 1 i C0040.</p> |
| C0040 | Indikator for præmierisici | <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Tildelt præmierisici — Ikke tildelt præmierisici |
| C0050 | Indikator for erstatningshensættelsesrisici | <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Tildelt erstatningshensættelsesrisici — Ikke tildelt erstatningshensættelsesrisici |
| C0060 | Andel af intern branche tildelt Solvens II-branche | Andel af intern branche tildelt Solvens II-branche, udtrykt som decimaltal, (f.eks. ved 10 % anvendes der 0,1). |

Risikomodelldata for bruttoerstatningshensættelsesrisici

| | | |
|-------|--------------------|--|
| Z0010 | Solvens II-branche | <p>Navnet på den branche inden for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, der indberettes. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring |
|-------|--------------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>10 — Retshjælpsforsikring</p> <p>11 — Assistance</p> <p>12 — Diverse økonomiske tab</p> <p>13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring</p> <p>15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring</p> <p>16 — Proportional motoransvarsgenforsikring</p> <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsegenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> |
| Z0020 | Risikotype | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko</p> <p>2 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret</p> <p>3 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko</p> <p>4 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer</p> |
| C0070 | Diversificeret erstatningshensættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv katastroferisici | <p>Aggregeret erstatningshensættelsesrisici med/uden fradrag af genforsikring efter anvendelse af diversifikationseffekter i forbindelse med forskellige risici.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil.</p> |
| C0080 | Solvens II-branche | <p>Erstatningshensættelsesrisici med/uden genforsikring for hver enkelt Solvens II-branche.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0090 | Intern branche | <p>Erstatningshensættelsesrisici med/uden genforsikring for hver enkelt intern branche.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil.</p> |
| R0070 | Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | <p>Bedste skøn over erstatningshensættelser (uden fradrag af genforsikring), som endnu ikke er afregnet, Det omfatter alle endnu ikke afregnede erstatningshensættelser, indberettet og ikke-indberettet. Baseret på Solvens II-direktivets artikel 77 svarer det bedste skøn til det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige cash flow under hensyntagen til den tidsmæssige værdi af penge (forventet nutidsværdi af de fremtidige cash flow) under anvendelse af den relevante risikofrie rentekurve.</p> |
| R0080 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshensættelsesrisici) | <p>Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, vedrørende direkte og accepteret forsikringsvirksomhed. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles erstatningshensættelsesrisici.</p> |
| R0090 | Solvenskapitalkrav | <p>De midler, som forsikrings- eller genforsikringsselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto.</p> <p>Denne celle repræsenterer den fritstående risiko for den respektive opdeling med anvendelse af den godkendte risikomåling i henhold til den interne model.</p> |
| R0100 | Simuleret (output) middelværdi | <p>Middelværdien for fordelingsprognosen vedrørende overskud og tab i henhold til den godkendte model, dvs. relevant for beregningen af det officielle solvenskapitalkrav. Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på udiskonteret basis).</p> |
| R0110 | Simuleret (output) standardafvigelse | <p>Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen af de fremtidige cash flow (kombineret kvotelignende (Combined ratio styled)) i tilknytning til forsikringsbegivenheder over en tidshorisont på et år pr. referencedatoen for indberetningen. Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis).</p> |
| R0120-R0330 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | <p>Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen af de fremtidige cash flow i tilknytning til forsikringsbegivenheder over en tidshorisont på et år pr. referencedatoen for indberetningen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis).</p> <p>Hvis definitionen af risikomåling er i tråd med definitionen af risikomåling i artikel 101 i Solvens II-direktivet, vil 99,5-percentilen være forskellig fra den simulerede (output) middelværdi fra solvenskapitalkravet.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| <i>Risikomodeldata for nettoerstatningshensættelsesrisici</i> | | |
| R0340 | Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | Bedste skøn over erstatningshensættelser (med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler), som endnu ikke er afregnet. Det omfatter alle endnu ikke afregnede erstatningshensættelser, indberettet og ikke-indberettet. Baseret på Solvens II-direktivets artikel 77 svarer det bedste skøn til det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige cash flow under hensyntagen til den tidsmæssige værdi af penge (forventet nutidsværdi af de fremtidige cash flow) under anvendelse af den relevante risikofrie rentekurve. |
| R0350 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshensættelsesrisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles erstatningshensættelsesrisici. |
| R0360 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
| R0370 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0380 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0390-R0600 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Risikomodeldata for bruttopræmierisici

| | | |
|-------|---|---|
| Z0020 | Risikotype | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Præmierisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko 2 — Præmierisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret 3 — Præmierisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko 4 — Præmierisici for skadesforsikringer |
| C0100 | Diversificeret erstatningshensættelsesrisici, eksklusive eksplicit katastroferisiko | Aggregeret præmierisici med/uden fradrag af genforsikring efter anvendelse af diversifikationseffekter blandt forskellige risici. Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| C0110 | Solvens II-branche | Præmierisici med/uden genforsikring for hver enkelt Solvens II-branche. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | | Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| C0120 | Intern branche | Præmierisici med/uden genforsikring for hver enkelt intern branche. Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| R0610 | Tegnede bruttopræmier | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldne til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. |
| R0620 | Bruttopræmieindtægter | summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. |
| R0630 | De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning | De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning, gennem bindende aftaler enten underskrevet før eller efter referencedatoen. |
| R0640 | Hensættelser for tegnede bruttopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | Hensættelser for tegnede præmier uden fradrag af genforsikring. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0650 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, vedrørende direkte og accepteret forsikringsvirksomhed. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0660 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto. |
| R0670 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for tabsandelen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0680 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0690-R0900 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| <i>Risikomodeldata for nettopræmierisici</i> | | |
| R0910 | Tegnede præmier, opgjort netto | Tegnede nettopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. |
| R0920 | Indtjent nettopræmie | Summen af tegnede nettopræmier minus ændringen i nettopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. |
| R0930 | De tegnede nettopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen | De tegnede nettopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning, gennem aftaler om tilsagn enten underskrevet før eller efter referencedatoen. |
| R0940 | Hensættelser for tegnede nettopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | Hensættelser for tegnede præmier med fradrag af genforsikring. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0950 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0960 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
| R0970 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0980 | Simuleret standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0990-R1200 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Samlet skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici uden fradrag af genforsikring

| | | |
|-------|------------|--|
| Z0020 | Risikotype | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko</p> <p>2 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret</p> |
|-------|------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--------------------------------------|--|
| | | <p>3 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko</p> <p>4 — Præmierisici og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer</p> <p>5 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, aggregeret separat med implicit katastroferisiko</p> <p>6 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, aggregeret separat.</p> |
| C0130 | Ikkediversificerede i alt | Det samlede beløb for skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici inden anvendelsen af diversifikationseffekter over for forskellige skadesforsikringsrisici. Beløbet vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmieerstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| C0140 | Diversifikation | Forskellen mellem den samlede ikkediversificerede enkeltstående forsikringsrisiko ved skades- og NSLT-sygeforsikring og den samlede diversificerede skadesforsikringsrisiko. Denne værdi er diversifikationseffekten og skal indberettes som en negativ værdi. |
| C0150 | Diversificeret | Det samlede beløb for skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici efter anvendelsen af diversifikationseffekter over for forskellige skadesforsikringsrisici. Beløbet vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmieerstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| R1210 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto. |
| R1220 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1230 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1240-R1450 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Samlet skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici med fradrag af genforsikring

| | | |
|-------|--------------------|--|
| R1460 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
|-------|--------------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---------------------------------------|--|
| R1470 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1480 | Simuleret (output) standard-afvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1490-R1700 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Fordeling af tab fra katastroferisici

| | | |
|-------|---|---|
| C0020 | Klasser, der er påvirket af katastrofebegivenheden | Liste over alle klasser, der er påvirket af katastrofebegivenheden for den relevante risiko. |
| C0160 | Katastrofal | Navnet på naturkatastrofe eller menneskeskabte risici for hver modelleret region. Anfør venligst betegnelsen for regionen og risikoen. Anfør ikke generiske betegnelser som region1 eller risiko1. Det henstilles at anvende engelske betegnelser for risici og regioner. |
| C0170 | Den kommercielt tilgængelige anvendte salgsmode (såfremt den findes) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: — Ja — Nej |
| C0180 | Den kommercielt tilgængelige anvendte salgsmode navn og udgave (såfremt den findes) | Hvis en kommercielt tilgængelig salgsmode anvendes i den interne model for risikoen, bør dette felt indeholde modellens betegnelse og den udgave af modellen, som simulationerne er baseret på. |
| C0190 | Forklarende oplysninger (hvis tabet ved AEP ikke er til rådighed) | Anfør korte og præcise oplysninger om model og årsager, hvis feltet »AEP-tab« ikke er til rådighed. Efter aftale med den ansvarlige tilsynsførende kan dette felt også anvendes til oplysninger om modelleringsmetoder i andre tilfælde. |
| C0200 | Forsikringssum i alt | Forsikrings- og genforsikrings-selskabet forventes at indberette den samlede forsikringssum for direkte forsikringsvirksomhed opdelt efter risiko og region. |
| C0210 | Eksponeringsbeløb | Det eksponeringsbeløb, der er anvendt af det selskab, som der sammen med den respektive tilsynsførende blev truffet aftale om. Det anvendte parameter kan være forskelligt for risici og regioner |
| C0220 | Eksponeringsparameter | Kort beskrivelse af det eksponeringsparameter, der er anvendt i foregående kolonne (C6). |

Fordeling af tab fra katastroferisici — Virksomhed i alt (ejendom og øvrig virksomhed)

| | | |
|-----------------------|---|--|
| Z0010 | Intern branche | Navnet på den interne branche, der er anvendt af selskabet. |
| C0230-C0400/ R1710 | Simuleret middelværdi fra modellen for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen svarende til den enkelte risiko og aggregering af risici. Output er opnået baseret på simulation. Middelværdien indberettes i henhold til følgende opdeling: — Middelværdi for OEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto — Middelværdi for AEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------------|--|---|
| | | <p>— Middelværdi for det årlige tab for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto</p> <p>— Middelværdi for OEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto</p> <p>— Middelværdi for AEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto</p> <p>— Middelværdi for det årlige tab for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto</p> <p>»Det årlige tab« er udtrykkeligt ikke »Det gennemsnitlige årlige tab« (AAL), men det tab, der fastsættes i henhold til statistisk måling, dvs. middelværdi, standardafvigelse eller percentil. AAL svarer til middelværdien for det årlige tab.</p> |
| C0230-C0400/ R1720 | Simuleret standardafvigelse for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen svarende til den enkelte risiko og aggregering af risici. Output er opnået baseret på simulation. Standardafvigelsen bør indberettes med den samme opdeling som den simulerede middelværdi. |
| C0230- C0400/R1730- R1810 | Simulerede percentiler for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | Percentiler fra sandsynlighedsfordelingen, som er opnået ved simulation, for hver risiko og aggregering af risici. De indberettede percentiler er 0,75, 0,9, 0,96, 0,98, 0,99, 0,995, 0,996, 0,998 og 0,999. Standardafvigelsen bør indberettes med den samme opdeling som den simulerede middelværdi. |

Data om præmier og forsikringssum

| | | |
|-----------------------|--|--|
| C0410/R1820- R1950 | Årlig bruttopræmie — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Opdeling af de årlige tegnede bruttopræmier for direkte forsikringsvirksomhed efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Afrika, Det nordøstlige USA, Det sydøstlige USA, Midtvesten i USA, Det vestlige USA, Nordamerika (undtagen USA), Caribien & Mellemamerika, Sydamerika, Australien, Japan, Asien (undtagen Japan) og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede.</p> <p>Definitionen af disse geografiske regioner findes i bilag III i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35. Når en af de ovenfor nævnte geografiske regioner omfatter flere af de definerede regioner i den delegerede forordning, bør alle lande i undergrupperne tages i betragtning for denne region. Den eneste undtagelse her er Japan som er adskilt fra resten af Asien.</p> |
| C0420/R1820- R1950 | Den samlede forsikringssum — Direkte forsikring | <p>Opdeling af den samlede forsikringssum for direkte forsikringsvirksomhed efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Afrika, Det nordøstlige USA, Det sydøstlige USA, Midtvesten i USA, Det vestlige USA, Nordamerika (undtagen USA), Caribien & Mellemamerika, Sydamerika, Australien, Japan, Asien (undtagen Japan) og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede.</p> <p>Definitionen af disse geografiske regioner findes i bilag III i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35. Når en af de ovenfor nævnte geografiske regioner omfatter flere af de definerede regioner i den delegerede forordning, bør alle lande i undergrupperne tages i betragtning for denne region. Den eneste undtagelse her er Japan som er adskilt fra resten af Asien.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0410/R1960-R1990 | Årlig bruttopræmie — Genforsikring | Forsikrings- og genforsikringsselskaber forventes at opdele deres årlige tegnede bruttopræmie for genforsikring efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Nordamerika og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. |
| C0420/R1960-R1990 | Den samlede forsikringssum — Genforsikring | Forsikrings- og genforsikringsselskaber forventes at opdele deres årlige tegnede bruttopræmie for genforsikring efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Nordamerika og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. |

OPDELING AF PRÆMIEINDTÆGTER

| | | |
|-------------|--------------------|---|
| C0430/R2000 | Direkte forsikring | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers direkte forsikringsvirksomhed |
| C0430/R2010 | Genforsikring | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers genforsikringsvirksomhed |
| C0430/R2020 | Retrocession | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers retrocession. |

ANDRE SIGNIFIKANTE RISICI

| | | |
|-------------|-----------------------------|---|
| C0440/R2030 | Andre signifikante risici | Forsikrings- og genforsikringsselskaber angiver her, hvis deres virksomhed indeholder andre signifikante risici, der ikke er omfattet af ovennævnte naturkatastrofer eller menneskeskabte risici, med et »ja«, i modsat fald angives »nej«. |
| C0440/R2040 | Beskrivelse af andre risici | Hvis der i ovennævnte celle er svaret »ja«, angiver forsikrings- og genforsikringsselskaber her en beskrivelse af denne eller disse andre signifikante risici. |

AGGREGERING AF SOLVENSKAPITALKRAVET FOR KATASTROFER — Indberettet med fradrag af genforsikring

| | | |
|-------------|---|---|
| C0450/R2050 | Samlet ikkediversificeret risiko ved naturkatastrofer | Summen af separate solvenskapitalkrav for alle naturkatastroferisici. |
| C0450/R2060 | Diversifikation mellem naturkatastroferisici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem naturkatastroferisici. Beregnet som solvenskapitalkrav for naturkatastroferisici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle naturkatastroferisici. |
| C0450/R2070 | Den samlede ikkediversificerede menneskeskabte risiko | Summen af solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici. |
| C0450/R2080 | Diversificering mellem menneskeskabte risici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem menneskeskabte risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for menneskeskabte risici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici. |
| C0450/R2090 | Andre skadesforsikringskatastroferisici | Solvenskapitalkrav for andre skadesforsikringskatastroferisici |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0450/R2100 | Diversifikation af andre skadesforsikringskatastroferisici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem andre risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for andre risici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle andre risici. |
| C0450/R2110 | Skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret i alt | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem naturkatastroferisici, menneskeskabte risici og andre risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for katastroferisici — solvenskapitalkrav for naturkatastroferisici — solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici — solvenskapitalkrav for alle andre risici. |
| C0450/R2120 | De samlede skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret | Solvenskapitalkrav for katastroferisici. |

S.26.14 — Intern model: Livs- og sygeforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

I dette skema indberettes resultaterne af interne modeller for livsforsikring og SLT-sygeforsikring. Hvis forsikringsvirksomheder også integrerer NSLT-sygeforsikringsrisici i modelstrukturen for livsforsikring og SLT-sygeforsikring, skal resultaterne fra modellen for NSLT-sygeforsikring også indberettes i dette skema.

Afhængig af strukturen i modelberegningen af livsforsikrings- og SLT-sygeforsikringsrisici skal én af de to fremgangsmåder for levetidsrisici og dødelighedsrisici anvendes. Hvis strukturen i den interne model er af en sådan art, at levetidsrisici og dødelighedsrisici modelberegnes sammen, indberettes der for disse risici kun R0270, hvor disse risici er kombineret.

Generelt set gælder, at hvis celler ikke på fornuftig vis kan indberettes, skal der vælges en alternativ løsning. Hvis f.eks. et selskab ikke kan adskille modelberegningen af tendenser, niveau eller volatilitet i et undermodul, angives disse oplysninger på det tilsvarende aggregerede niveau.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

VALGMULIGHED 1 — LIVSFORSIKRINGSRISICI

| | | |
|---|---|---|
| C0010/R0010, R0060, R0250, R0270 C0030-C0040/ R0110 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«). Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010 (Dødelighed) og R0060 (Levetid) ikke. |
| C0050/R0010, R0060, R0110, R0250, R0270 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier med fradrag af genforsikring indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010 (Dødelighed) og R0060 (Levetid) ikke. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---|---------------------------------|--|
| C0060/R0010, R0060, R0110, R0250, R0270 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010 (Dødelighed) og R0060 (Levetid) ikke. |
| C0070/R0010- R0270 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. De følgende forklaringer gælder for C0070 — C0260: For de aggregerede risici skal solvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende underrisici indberettes. For optionsrisici gælder følgende: — »Optionsrisici« omfatter udøvelsen af aftalebestemte optioner i bred forstand. — Risiko for en stigning i optionsintensiteten (R0170) og et fald i optionsintensiteten (R0180) er andre optionsrisici end masseoptionsrisici, hvor R0170 (R0180) omfatter den del af virksomheden, der fører til et tab, hvis optionsintensiteten stiger (falder), som defineret i den interne model. — Masseoptionsrisici (R0190) er risikoen for akkumulering eller katastroferisici i forbindelse med optionsrisici, som defineret i den interne model. — »Opdeling af optionsrisici (som ikke er masseoptionsrisici)« omfatter ikke-masseoptionsrisici, hvis en opdeling i stigning/fald ikke er til rådighed, og kan opdeles i tre brede kategorier: »fuldstændigt genkøb«, dvs. kontraktens ophør, »delvis genkøb« og »andet«, hvilket er en udnyttelse af de aftalebestemte optioner eller »forsikringstagers adfærd«. Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010-R0100 ikke. |
| C0080/R0010- R0270 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010-R0100 ikke. |
| C0090/R0010- R0270 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010-R0100 ikke. |
| C0100- C0310/R0010- R0270 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). Hvis R0270 indberettes, så indberettes R0010-R0100 ikke. |

VALGMULIGHED 2 — LIVSFORSIKRINGSRISICI

Skal udfyldes, hvis den interne model kun har en opdeling mellem tendensrisiko og niveaurisiko. I så fald erstatter følgende skema (S.26.14.01.02) ovennævnte skema (S.26.14.01.01).

| | | |
|-------------|---|---|
| C0010/R0300 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn for katastroferisici indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. |
|-------------|---|---|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|---|
| C0050/R0300 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto for katastroferisici indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0300 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb for katastroferisici indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0280-R0300 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. For de aggregerede risici skal nettosolvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes. |
| C0080/R0280-R0300 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet |
| C0090/R0280-R0300 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0280-R0300 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

VALGMULIGHED 1 — SUNDHEDSRISICI

| | | |
|--|---|---|
| Z0010 | Type sygeforsikringsrisici modelberegnet i livs- og sygeforsikringsrisici? | I den udtømmende liste findes der tre muligheder: SLT, NSLT og SLT+NSLT |
| C0010/R0310, R0360, R0560 C0030-C0040/R0410-R0460 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«). |
| C0050/R0310, R0360, R0410-R0460, R0560 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0310, R0360, R0410-R0460, R0560 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0310-R0570 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. De følgende forklaringer gælder for C0070 — C0260: For de aggregerede risici skal solvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | <p>For optionsrisici gælder følgende::</p> <ul style="list-style-type: none"> — »Optionsrisici« omfatter udøvelsen af aftalebestemte optioner i bred forstand. — Risiko for en stigning i optionsintensiteten (R0480) og et fald i optionsintensiteten (R0490) er andre optionsrisici end masseoptionsrisici, hvor R0480 (R0490) omfatter den del af virksomheden, der fører til et tab, hvis optionsintensiteten stiger (falder), som defineret i den interne model. — Masseoptionsrisici (R0500) er risikoen for akkumulering eller katastroferisici i forbindelse med optionsrisici, som defineret i den interne model. <p>»Opdeling af optionsrisici (som ikke er masseoptionsrisici)« omfatter ikke-masseoptionsrisici, hvis en opdeling i stigning/fald ikke er til rådighed, og kan opdeles i tre brede kategorier: »fuldstændigt genkøb«, dvs. kontraktens ophør, »delvis genkøb« og »andet«, hvilket er en udnyttelse af de aftalebestemte optioner eller »forsikringstagers adfærd«.</p> |
| C0080/R0310-R0570 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto |
| C0090/R0310-R0570 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0310-R0570 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

VALGMULIGHED 2 — SUNDHEDSRISICI

Skal udfyldes, hvis den interne model kun har en opdeling mellem tendensrisiko og niveaurisiko. I så fald erstatter følgende skema (S.26.14.01.05) ovennævnte skema (S.26.14.01.03).

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0010/R0600 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | <p>Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå.</p> <p>Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«).</p> |
| C0050/R0600 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0600 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0580-R0600 | Solvenskapitalkrav | <p>Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring.</p> <p>For de aggregerede risici skal nettosolvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|--|
| C0080/R0580-R0600 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto |
| C0090/R0580-R0600 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0580-R0600 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

SOLVENSKAPITALKRAV

| | | |
|-------------|--|--|
| C0320/R0610 | Samlet ikkediversificeret risiko: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | Summen af alle (under)solvenskapitalkrav. Med hensyn til optionsrisici vælges den sum, der er hensigtsmæssig for opdelingen på det mest detaljerede niveau. Eksempler: 1) Hvis optionsrisici stiger, og optionsrisici falder, og masseoptionsrisici er til rådighed, skal disse lægges sammen. Uanset om opdelingen af optionsrisici også er til rådighed. 2) Hvis masseoptionsrisici og opdeling af optionsrisici er til rådighed, herunder også opdeling af optionsrisici på underniveau, lægges summen af masseoptionsrisici og opdeling af optionsrisici sammen. Hvis der kun findes underniveauer af opdeling af optionsrisici, vælges disse. |
| C0320/R0620 | Diversifikation: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | Diversificeringen mellem underrisici. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0320/R0630 | Diversificeret risiko: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | De aggregerede solvenskapitalkrav for livsforsikring eller sygeforsikring efter aggregering af alle underrisici. |

S.26.15 — Intern model: Operationelle risici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De oplysninger, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og forsikrings- og genforsikringsselskaberne.

Hvert selskab kan anvende sin egen klassifikation af operationelle risici.

Kolonne C0020-C0060 indeholder oplysninger om de scenarier, som selskabet har defineret. Hvis der findes klassificeringer på flere niveauer, angives der som minimum data for de to højeste niveauer af operationelle risici (definer L1 som det højeste og L2, hvis det findes, som det umiddelbart følgende). Alle de oplysninger, der skal angives, er knyttet til den 1-årige prognostiserede sandsynlighedsfordeling af tab.

For en begivenhedstype, der er defineret som en niveau 1-begivenhed (L1), bør alle numeriske oplysninger (solvenskapitalkrav, fraktiler) henvise til den risikoaggregering, der er sket på dette niveau. Hver kategori, som er klassificeret som en niveau 2-begivenhed (L2), kan stamme fra en aggregering af lavere niveauer af fordelingerne af tab.

| Intern klassificering af scenarier [fritekst] | Unik ID [tal] | Unik ID for moderselskabet. [tal] | |
|--|------------------|--------------------------------------|--|
| L2 A | 201 | 101 | Bemærk, at ID for det relevante niveau ikke vurderes for L1-niveauer, da niveauet for det øverste moderselskab i sig selv er den operationelle risiko. |
| L2 B | 202 | 101 | |
| L2 C | 203 | 101 | |
| L2 D | 204 | 102 | |
| L2 E | 205 | 102 | |
| L1 A | 101 | | |
| L1 B | 102 | | |

Operationelle risici

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Er Basel L1 klassifikationen anvendt? | Angiv, om de syv højniveaukategorier (L1), der er anført i Basel II, er anvendt. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: — Ja — Nej |
| C0010/R0020 | Er Basel L1- og L2-klassifikationen anvendt? | Angiv, om Baselkategorierne niveau 1 og 2 og deres hierarki (hvilke L2 der indgår i den enkelte L1) er specificeret i Basel II [Bilag 7]. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: — Ja — Nej |
| C0020 | Navnet på scenariet | Dette skema skal udfyldes af alle selskaber, også i tilfælde, hvor selskabet svarer »Nej« til C0010/R0010 og/eller C0010/R0020, med angivelse af navnene på de interne scenarier, der er anvendt i den interne model til beregninger af den operationelle risiko. |
| C0030 | Unik ID | Det er et unikt ID for det interne scenario. Det bør være konsistent over tid. Dette er et numerisk felt. |
| C0040 | Unik ID for moderselskabet. | Det er et unikt ID for det interne scenario hos det umiddelbare moderselskab. Det bør være konsistent over tid. Dette er et numerisk felt. |
| C0050 | Indpasning i Basel L1-klassifikation | For udfyldelse af selskaber, som svarer »ja« i C0010/R0010, eller for hvilke der findes en indpasning i Basel L1. Feltet bør være tomt, hvis scenariet er højere end L2 i klassifikationen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|---|
| | | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Intern svig 2) Ekstern svig 3) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen 4) Skader på fysiske aktiver 5) Forretningsforstyrrelser og systemfejl 6) Kunder, produkter og forretningspraksis 7) Ordreforfikling, levering og procesforvaltning |
| C0060 | Indpasning i Basel L2-klassifikation | <p>For udfyldelse af selskaber, som svarer »ja« i C0010/R0020, eller for hvilke der findes en indpasning i Basel L2. Feltet bør være tomt, hvis scenariet er højere end L2 i klassifikationen.</p> <p>Begivenheden »Andet« kan anvendes, hvis risikoen kan klassificeres i en Basel-kategori L1, men der findes ingen L2.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Intern svig — Uautoriseret aktivitet 2) Intern svig — Tyveri og svig 3) Intern svig — Andet 4) Ekstern svig — Tyveri og svig 5) Ekstern svig — Systemsikkerhed 6) Ekstern svig — Andet 7) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Relationer mellem ansatte 8) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Sikkert miljø 9) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Diversitet og diskriminering 10) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Andet 11) Skader på fysiske aktiver — Katastrofer og andre begivenheder 12) Skader på fysiske aktiver — Andet 13) Forretningsforstyrrelser og systemfejl — Systemrelateret 14) Forretningsforstyrrelser og systemfejl — Andet 15) Kunder, produkter og forretningspraksis — Egnethed, offentliggørelse og forvaltning 16) Kunder, produkter og forretningspraksis — Ukorrekt forretnings- eller markedspraksis 17) Kunder, produkter og forretningspraksis — Produktfejl 18) Kunder, produkter og forretningspraksis — Udvælgelse, sponsorering og eksponering 19) Kunder, produkter og forretningspraksis — Rådgivningsaktiviteter |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | <p>20) Kunder, produkter og forretningspraksis — Andet</p> <p>21) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Registrering, afvikling og vedligeholdelse af transaktioner</p> <p>22) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Overvågning og indberetning</p> <p>23) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Tilførsel af kunder og dokumentation</p> <p>24) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Kundeadministration</p> <p>25) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Handelspartner</p> <p>26) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Sælgere og leverandører</p> <p>27) Ordreaftervikling, levering og procesforvaltning — Andet</p> |
| C0070 | Sandsynlighedsfordeling | <p>Angiv sandsynlighedsfordelingen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Poisson-lognormal 2. Lognormal 3. Poisson-Pareto 4. Empirisk 5. Pareto 6. Andet, anfør nærmere 7. Opnået ved aggregering af lavere niveauer <p>Post 1 til 6 skal anvendes, hvis sandsynlighedsfordelingen kvantificeres, post 7 anvendes, hvis sandsynlighedsfordelingen opnås ved aggregering af lavere niveauer.</p> |
| C0080 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav med fradrag af risikoreducerende aftaler pr. scenario. |
| C0090-C0210 | percentiler | Percentiler for fordelingen af tab (tab svarer til den højre del) med fradrag af de risikoreducerede aftaler pr. scenario. |
| C0220/R0030 | Det samlede niveau 2, ikke-diversificeret | <p>Summen af fritstående kapitalkravsbidrag for operationelle risici i henhold til niveau 2-klassifikationen.</p> <p>Et lavere aggregeringsniveau bør allerede overvejes.</p> |
| C0220/R0040 | Summen af diversifikation blandt poster på niveau 2 | <p>Forskellen mellem summen af solvenskapitalkrav for ikke-diversificerede delrisici (leaf risks) og C0220/R0030.</p> <p>Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi.</p> <p>F.eks. hvis det lavere niveau er L3 (dem med kvantificeret sandsynlighedsfordeling) indsæt forskellen mellem summen i L3 og summen i L2 (enkeltstående).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0220/R0050 | Det samlede niveau 1, ikkedi-versificeret | Summen af fritstående kapitalkravsbidrag for operationelle risici i henhold til niveau 1-klassifikationen (i givet fald med fradrag af risikoreducerende aftaler). Et lavere aggregeringsniveau bør allerede overvejes. |
| C0220/R0060 | Operationelle risici — diversifikation mellem poster på niveau 1 | Forskellen mellem C0220/R0050 og C0220/R0070. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0220/R0070 | Operational risiko — diversificeret | Kapitalkrav for diversificeret operationel risiko med fradrag af risikoreducerende aftaler |

S.26.16 — Intern model — Ændringer af modellen

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Formålet med dette skema er at indsamle oplysninger om karakteristika ved ændringer af modellen, som sker i henhold til den godkendte politik for ændring af modeller, og om hvordan solvenskapitalkravet har ændret sig i en årlig indberetningsperiode som følge af de ændringer, der blev gennemført i den pågældende periode. Denne periode kan adskille sig fra den periode, der er fastlagt ved politikken for ændring af modeller, f.eks. for akkumulering af mindre ændringer.

Mindre ændringer af modellen skal ikke tælles dobbelt inden for eller på tværs af indberetningsperioder. Hvis en betydelig ændring indeholder mindre ændringer eller er en akkumulering af mindre ændringer, foretages der derfor enten:

- en fjernelse af indvirkningen af disse mindre ændringer i den betydelige ændring, hvis de mindre ændringer blev gennemført i en tidligere indberetningsperiode, eller
- disse inkluderes i »de samlede mindre ændringer«, og deres virkning fjernes fra den betydelige ændring som følge af en akkumulering af virkningen af mindre ændringer.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------------|------------------|---|
| <i>Type ændring</i> | | |
| C0010 | Betydelig | Oplysninger i denne række skal henvise til en betydelige ændring (i en given indberetningsperiode). En række betydelige ændringer kan samles i en enkelt <i>godkendelse</i> , men de bør adskilles i de tilfælde, hvor der er klare betydelige ændringer. Navngivningskonvention: betydelig ændring 1_Komponent 1 |
| <i>Ændrings-ID</i> | | |
| C0020 | Ændrings-ID | Dette ændrings-ID bør være konsistent mellem indberetning som enkelt selskab og som koncern. Det anvendes for at matche de ændringer for enkeltsselskaber, der svarer til ændringen for koncernen i indberetningsperioden. |
| <i>Beskrivelse af ændring</i> | | |
| C0030 | Godkendelsesdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor godkendelsen bevilges i henhold til beslutningen truffet af den berørte nationale kompetente myndighed. |
| C0040 | Indgivelsesdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den skriftlige anmodning om godkendelse til den berørte nationale kompetente myndighed (med henblik på godkendelse af ændringer) blev indgivet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0050 | Beskrivelse af ændring af politikken | En kort beskrivelse af ændringens art og hvilke aspekter af modellen, der er blevet ændret. |
| C0060 | Ændring som følge af | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ændring i risikoprofil 2 — Ændring i inputdata og antagelser 3 — Ændring i metode 4 — Andet |
| C0070 | Anden kategorisering og forklaring | Beskriv kategoriseringen, hvis denne er forskellig fra kolonne C0060. Hvis udfyldt, anvend valgmuligheden »Andet« under kolonne C0060. |
| C0080 | Indvirkning på markedsrisici | Hvis kapitalkravet for markedsrisici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0090 | KREDITrisiko ved finansielle instrumenter, indvirkning | Hvis kapitalkravet for kreditrisici ved finansielle instrumenter påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0100 | KREDITrisiko ved ikkefinansielle instrumenter, indvirkning | Hvis kapitalkravet for kreditrisici ved ikke-finansielle instrumenter påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0110 | Indvirkning på risici ved skades- og NSLT-sygeforsikring | Hvis kapitalkravet for risici ved skades- og NSLT-sygeforsikring påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0120 | Indvirkning på risici ved livs- og sygeforsikring | Hvis kapitalkravet for risici ved livs- og sygeforsikring påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0130 | Indvirkning på operationelle risici | Hvis kapitalkravet for operationelle risici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0140 | Indvirkning på pensionsrisici | Hvis kapitalkravet for pensionsrisici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0150 | Indvirkning på afhængighedsstruktur og -korrelation | Hvis diversificeringsfordelene som følge af ændringer af afhængighedsstrukturen og/eller -korrelationen påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0160 | Anden begrundelse (fri tekst) | Beskriv, hvordan (eventuelle) andre modelbereggede bidrag til solvenskapitalkravet blev påvirket af ændringen af modellen. |
| C0170 | Ændringens betegnelse | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Kvalitativ 2 — Kvantitativ 3 — Kombination af kvantitativ/kvalitativ |

Virksomheden af ændringer

| | | |
|-------|---|--|
| C0180 | Den samlede værdi af solvenskapitalkrav før ændringer (beløb) | De samlede solvenskapitalkrav (fuldstændig modelberegning inklusive den del af standardformlen for partielle interne modeller og diversifikationsfordele) inden modelændring, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0190 | Referencedato for indvirkning på solvenskapitalkravet | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for referencedatoen for indvirkning på solvenskapitalkravet forårsaget af modelændringen (kun betydelige ændringer). Dato, som angives af de nationale kompetente myndigheder i brevet om godkendelse af anvendelsen af den betydelige ændring, og fra hvilken den godkendte model kan anvendes til beregning af solvenskapitalkravet. |
| C0200 | Den samlede værdi af solvenskapitalkrav efter ændringer (beløb) | De samlede solvenskapitalkrav (om nødvendigt fuldstændig modelberegning inklusive den del af standardformlen for partielle interne modeller og diversifikationsfordele) efter modelændring, som angivet i ansøgningen om modelændring, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0210 | Den samlede ændring af solvenskapitalkravet i % | Den relative ændring af de samlede solvenskapitalkrav i procent udelukkende i forhold til større ændringer. |
| C0220 | Kapitalgrundlag uden ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden modelændringer, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0540/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0660/C0010 for koncerner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------------|--|
| C0230 | Kapitalgrundlag med ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag med modelændringer, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0540/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0660/C0010 for koncerner. |
| C0260 | Anden udløsende værdi | Hvis ikke ændringen i solvenskapitalkravet er den udløsende værdi, der har ført til klassificeringen af betydelig ændring, angives der her, hvilke kriterier der klassificerer ændringen som betydelig (kun den relevante udløsende værdi, som førte til ændringen). |
| C0270 | Anden udløsende værdi (beløb) | Beløbet for indvirkningen af den udløsende værdi i C0260 (ud over solvenskapitalkravet) |
| C0280 | Anden udløsende værdi (i %) | Indvirkningen i procent med hensyn til den udløsende værdi i C0260 (ud over solvenskapitalkravet) |

Mindre ændringer

| | | |
|-------|---|---|
| C0220 | Kapitalgrundlag uden ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden mindre modelændringer |
| C0230 | Kapitalgrundlag med ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden mindre modelændringer plus summen af indvirkninger af de mindre modelændringer på det samlede anerkendte kapitalgrundlag i denne indberetningsperiode. |
| C0240 | Summen af solvenskapitalkrav for mindre ændringer, der øger solvenskapitalkravet | Summen af indvirkninger, men kun de mindre modelændringer, på de samlede solvenskapitalkrav, hvorved solvenskapitalkravet blev øget for denne indberetningsperiode. Referenceværdien for det anvendte solvenskapitalkrav er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0250 | Summen af solvenskapitalkrav for mindre ændringer, der reducerer solvenskapitalkravet | Summen af indvirkninger, men kun de mindre modelændringer, på de samlede solvenskapitalkrav, hvorved solvenskapitalkravet blev reduceret for denne indberetningsperiode, i indberetningsvalutaenheder. Referenceværdien for det anvendte solvenskapitalkrav er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0290 | Antal mindre ændringer, der er gennemført i indberetningsperioden | Antal mindre ændringer, der er gennemført i indberetningsperioden. |
| C0300 | Akkumuleringstærskel | Akkumuleringstærskel som anført i politikken for ændring af modeller. |
| C0310 | Nulstilling | Angiv, om der er sket en nulstilling af akkumuleringen af mindre ændringer i indberetningsperioden: <ul style="list-style-type: none"> — Nulstilling af mindre ændringer i forbindelse med den interne model i indberetningsperioden — Ingen nulstilling af mindre ændringer i forbindelse med den interne model i indberetningsperioden |
| C0320 | Årsagen til nulstilling | Anfør kort begrundelsen for, hvorfor der er sket en nulstilling af akkumuleringen af mindre ændringer i indberetningsperioden. |

S.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Captive-forsikrings- og -genforsikringsselskaber, der opfylder betingelserne i artikel 4, stk. 4 og 5, skal kun indberette tabeller, der svarer til R0001 og R002/C0001 og R0010/C0010 til R0340/C0030.

Skema SR.27.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Formålet med dette skema er at give indsigt i, hvordan katastroferisikomodulet i solvenskapitalkravet er blevet beregnet, og hvad de vigtigste elementer er.

For hver type katastroferisiko skal den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er bestemmes. Denne beregning er prospektiv og skal være baseret på genforsikringsprogrammet for næste regnskabsår som beskrevet i genforsikringsskemaerne for fakultative dækninger (S.30.01 og S.30.02) og cederede genforsikringsprogrammer i næste regnskabsår (S.30.03 og S.30.04).

Selskaberne skal foretage et skøn over deres genindvinding fra risikoreduktion i overensstemmelse med direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og relevante tekniske standarder. Selskaberne skal kun udfylde katastrofeindberetningsskemaet med den detaljeringsgrad, der er nødvendig for at foretage denne beregning.

I skades- og sygeforsikringsrisikomodulet defineres katastroferisiko som tabsrisiko eller risiko for en negativ udvikling i værdien af forsikringsforpligtelser som følge af betydelig usikkerhed omkring antagelser vedrørende præmier og hensættelser relateret til ekstreme eller usædvanlige begivenheder, jf. artikel 105, stk. 2, litra b), og stk. 4, litra c), i direktiv 2009/138/EF.

Det indberettede kapitalkrav afspejler kapitalkravene før og efter risikoreduktion, hvilket er den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er. Det indberettede kapitalkrav efter risikoreduktion angives, uden at der tages hensyn til de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Standardværdien af risikoreduktionen skal indberettes som en positiv værdi for at kunne fratrækkes.

Hvis diversifikationseffekten nedsætter kapitalkravet, indberettes standardværdien for diversifikationen som en negativ værdi.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0001/C0001 | Anvendte forenklinger — brandrisici | Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenklinger med henblik på artikel 90c 9 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0001/C0001 = 1, udfyldes kun C0880 med henblik på R2600. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0002/C0001 | Anvendte forenklinger — naturkatastroferisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af livsforsikringskatastroferisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Forenkling med henblik på artikel 90b — storm</p> <p>2 — Forenkling med henblik på artikel 90b — jordskælv</p> <p>3 — Forenkling med henblik på artikel 90b — oversvømmelse</p> <p>4 — Forenkling med henblik på artikel 90b — hagl</p> <p>5 — Forenkling med henblik på artikel 90b — jordskred</p> <p>9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 1 til 5 kan anvendes samtidigt.</p> |

Skadesforsikringskatastroferisici — Oversigt

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0010/R0010 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0070. |
| C0010/R0020–R0060 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Naturkatastroferisici | <p>Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. naturkatastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner.</p> <p>Pr. naturkatastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion.</p> |
| C0010/R0070 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0020/R0010 | Samlet risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0070. |
| C0020/R0020–R0060 | Samlet risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. naturkatastroferisiko. |
| C0020/R0070 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0030/R0010 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0070. |
| C0030/R0020–R0060 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. naturkatastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | | Pr. naturkatastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0070 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0010/R0080 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Katastroferisiko vedrørende ikkeproportional ejendomsforsikring | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| C0020/R0080 | Samlet risikoreduktion — katastroferisiko i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| C0030/R0080 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — katastroferisiko i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| C0010/R0090 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0160. |
| C0010/R0100–R0150 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. menneskeskabt katastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner. Pr. menneskeskabt katastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion. |
| C0010/R0160 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |
| C0020/R0090 | Samlet risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0160. |
| C0020/R0100–R0150 | Samlet risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. menneskeskabt naturkatastroferisiko. |
| C0020/R0160 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0030/R0090 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0160. |
| C0030/R0100–R0150 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. menneskeskabt katastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem delrisici. Pr. menneskeskabt katastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0160 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |
| C0010/R0170 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0180. |
| C0010/R0180 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0170 | Samlet risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0180. |
| C0020/R0180 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0030/R0170 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0180. |
| C0030/R0180 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0010/R0190 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskeskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |
| C0010/R0200 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskeskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|--|
| C0010/R0210 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0010/R0200. |
| C0020/R0190 | Samlet risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |
| C0020/R0200 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |
| C0020/R0210 | Samlet risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0020/R0200. |
| C0030/R0190 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |
| C0030/R0200 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler. | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |
| C0030/R0210 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0030/R0200. |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | |
| C0010/R0300 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0010/R0340. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0010/R0310–R0330 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici under hensyn til diversifikationseffekten mellem landene. Pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion. |
| C0010/R0340 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0300 | Samlet risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0340. |
| C0020/R0310–R0330 | Samlet risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0340 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0030/R0300 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0030/R0340. |
| C0030/R0310–R0330 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici under hensyn til diversifikationseffekten mellem landene. Pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0340 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler. | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| <i>Skadesforsikringskatastroferisici</i> | | |
| <i>Naturkatastroferisici — Storm</i> | | |
| C0040/R0610–R0780 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringselskabet det følgende år skal tjene vedrørende de 14 andre regioner ud over de specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Forsikring mod brand og andre skader på ejendom dækkende stormrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, og sø-, luftfarts- og transportforsikring dækkende skade på landbaseret ejendom forårsaget af storm, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| | | Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler. |
| C0040/R0790 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikringselskabet skal tjene det følgende år før diversifikation for de 14 andre regioner end de specificerede-regioner. |
| C0050/R0400–R0590 | Eksponering — specificeret-region | Den samlede forsikringssum for hver af de 23 specificerede-regioner for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35;: — brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker stormrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region, og — luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af storm, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0050/R0600 | Eksponering — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksponering før diversifikation for de 23 specificerede-regioner. |
| C0060/R0400–R0590 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende storm for hver af de 23 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0060/R0600 | Specificeret bruttotab — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab før diversifikation for de 23 specificerede-regioner. |
| C0070/R0400–R0590 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 23 specificerede-regioner ved risiko for storm, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0070/R0600 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for storm for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0080/R0400–R0590 | Scenario A eller B — specificeret-region | Den største værdi af kapitalkravet for stormrisici for hver af de 23 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B. Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko. |
| C0090/R0400–R0590 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for hver af de 23 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0090/R0600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for de 23 specificerede-regioner. |
| C0090/R0790 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for stormrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0090/R0800 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for alle regioner. |
| C0090/R0810 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af stormrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0090/R0820 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for stormrisici under hensyn til diversifikationseffekten som indberettet under post C0090/R0810. |
| C0100/R0400–R0590 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 23 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0100/R0600 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion i tilknytning til storm for de 23 specificerede-regioner. |
| C0100/R0790 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0100/R0800 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion i tilknytning til storm for alle regioner. |
| C0110/R0400–R0590 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 23 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, for det valgte scenario, i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0110/R0600 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 23 specificerede-regioner. |
| C0110/R0790 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0110/R0800 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0120/R0400–R0590 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende storm i hver af de specificerede-regioner, for det valgte scenario. |
| C0120/R0600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 23 specificerede-regioner. |
| C0120/R0790 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for stormrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0120/R0800 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |
| C0120/R0810 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for stormrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0120/R0820 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for stormrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0120/R0810. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | Naturkatastrofe- risici — Jord- skælv | |
| C0130/R1040– R1210 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene vedrørende hver af de 14 andre regioner ud over EØS-regionerne (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende følgende brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom dækkende jordskælvsrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, og — luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af jordskælv, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0130/R1220 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for jordskælv for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene for de andre regioner. |
| C0140/R0830– R1020 | Eksposering — specificeret-region | <p>Den samlede forsikringssum for hver af de 20 specificerede-regioner for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35.:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker jordskælvsrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region, og — For brancherne luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af jordskælv, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0140/R1030 | Eksposering — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksposering for de 20 specificerede-regioner. |
| C0150/R0830– R1020 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende jordskælv for hver af de 20 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0150/R1030 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0160/R0830– R1020 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 20 specificerede-regioner ved risiko for jordskælv efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0160/R1030 | Kapitalkravs faktor for katastroferisiko — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0170/R0830–R1020 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Specificeret region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv i hver af de 20 specificerede-regioner. |
| C0170/R1030 | Kapitalkrav for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0170/R1220 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for jordskælvsrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0170/R1230 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv for alle regioner. |
| C0170/R1240 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af jordskælvsrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0170/R1250 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for jordskælvsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0170/R1240. |
| C0180/R0830–R1020 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 20 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0180/R1030 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 20 specificerede-regioner. |
| C0180/R1220 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0180/R1230 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |
| C0190/R0830–R1020 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 20 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0190/R1030 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 20 specificerede-regioner. |
| C0190/R1220 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0190/R1230 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0200/R0830–R1020 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv i hver af de 20 specificerede-regioner. |
| C0200/R1030 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0200/R1220 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskælvsrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0200/R1230 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv for alle regioner. |
| C0200/R1240 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for jordskælvsrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0200/R1250 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskælvsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0200/R1240. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | Naturkatastroferisici — Oversvømmelse | |
| C0210/R1410–R1580 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene vedrørende hver af de 14 andre regioner ud over de specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende følgende brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom dækkende oversvømmelsesrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser — luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser — anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0210/R1590 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene for de andre regioner. |
| C0220/R1260–R1390 | Eksposering — specificeret-region | <p>Den samlede forsikringssum for hver af de 14 specificerede-regioner for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker oversvømmelsesrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region — luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. og — anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, ganget med 1,5, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0220/R1400 | Eksposering — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksposering for de 14 specificerede-regioner. |
| C0230/R1260–R1390 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende oversvømmelse for hver af de 14 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0230/R1400 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende oversvømmelse for de 14 specificerede-regioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0240/R1260-R1390 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 14 specificerede-regioner ved risiko for oversvømmelse efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0240/R1400 | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0250/R1260-R1390 | Scenario A eller B — specificeret-region | Den største værdi af kapitalkravet for oversvømmelsesrisici for hver af de 14 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B. Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der under alle omstændigheder tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko. |
| C0260/R1260-R1390 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for hver af de 14 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |
| C0260/R1400 | Kapitalkrav for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for de 14 specificerede-regioner. |
| C0260/R1590 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for oversvømmelsesrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0260/R1600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for alle regioner. |
| C0260/R1610 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af oversvømmelsesrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0260/R1620 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for oversvømmelsesrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0260/R1610. |
| C0270/R1260-R1390 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 14 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0270/R1400 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 14 specificerede-regioner. |
| C0270/R1590 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0270/R1600 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |
| C0280/R1260–R1390 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 14 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, for det valgte scenario, i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0280/R1400 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 14 specificerede-regioner. |
| C0280/R1590 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0280/R1600 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — Alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0290/R1260–R1390 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende oversvømmelse i hver af de 14 specificerede-regioner, for det valgte scenario. |
| C0290/R1400 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 14 specificerede-regioner. |
| C0290/R1590 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0290/R1600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------------|--|---|
| C0290/R1610 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0290/R1620 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0290/R1610. |
| Naturkatastroferisici — Hagl | | |
| C0300/R1730–R1900 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene, vedrørende hver af de 11 andre regioner ud over de specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35), for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom dækkende haglrисici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser — luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. og — anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0300/R1910 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene for de andre regioner. |
| C0310/R1630–R1710 | Eksposering — specificeret-region | <p>Den samlede forsikringssum for hver af de 11 specificerede-regioner for brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker haglrисici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region — luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. og — anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, ganget med 5, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0310/R1720 | Eksposering — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksposering for de 11 specificerede-regioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0320/R1630–R1710 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende hagl for hver af de 9 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0320/R1720 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende hagl for de 11 specificerede-regioner. |
| C0330/R1630–R1710 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 11 specificerede-regioner ved risiko for hagl efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0330/R1720 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0340/R1630–R1710 | Scenario A eller B — specificeret-region | Den største værdi af kapitalkravet for haglrисici for hver af de 9 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B. Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der under alle omstændigheder tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko. |
| C0350/R1630–R1710 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for hver af de 11 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |
| C0350/R1720 | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for de 11 specificerede-regioner. |
| C0350/R1910 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for haglrисici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0350/R1920 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for alle regioner. |
| C0350/R1930 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af haglrисici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0350/R1940 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for haglrисici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0350/R1930. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0360/R1630–R1710 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 9 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0360/R1720 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 11 specificerede-regioner. |
| C0360/R1910 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0360/R1920 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |
| C0370/R1630–R1710 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 11 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, svarende til det valgte scenario, i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0370/R1720 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 11 specificerede-regioner. |
| C0370/R1910 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0370/R1920 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0380/R1630–R1710 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende hagl i hver af de 11 specificerede-regioner, for det valgte scenario. |
| C0380/R1720 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 11 specificerede-regioner. |
| C0380/R1910 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for haglrисici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------------------|---|---|
| C0380/R1920 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |
| C0380/R1930 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for haglrисici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0380/R1940 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for haglrисici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0380/R1930. |
| Naturkatastroferisici — Jordskred | | |
| C0390/R1950 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Jordskred i alt før diversifikation | Et skøn over de præmier, der det følgende år skal tjenes af forsikrings- eller genforsikringsselskabet for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brand og anden skade på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. Præmierne skal angives brutto, uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, vedrørende Frankrigs territorium. |
| C0400/R1950 | Eksposering — Jordskred i alt før diversifikation | Den samlede forsikringssum for de geografiske opdelinger af Frankrigs territorium vedrørende brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, som er tilstrækkeligt homogene i tilknytning til den jordskredsrisiko, som forsikrings- og genforsikringsselskaberne er eksponeret for vedrørende territoriet. Områderne lagt sammen udgør det samlede territorium. |
| C0410/R1950 | Specificeret bruttotab — Jordskred i alt før diversifikation | Specificeret bruttotab vedrørende jordskred før hensyntagen til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0420/R1950 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskred før diversifikation | Kapitalkravsfaktor for Frankrigs territorium ved risiko for jordskred, før hensyntagen til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0430/R1950 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for jordskredsrisici på Frankrigs territorium. Det umiddelbare tab, uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, som for jordskred er lig med de specificerede bruttotab (post C0410/R1950). |
| C0430/R1960 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem områder | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af jordskredsrisici vedrørende de forskellige områder på Frankrigs territorium. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| C0430/R1970 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Jordskred i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for jordskredsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0430/R1960. |
| C0440/R1950 | Skønnet risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0450/R1950 | Skønnede genindsættelsespræmier — Jordskred i alt før diversifikation | De skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0460/R1950 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskred. |
| C0460/R1960 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem områder | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for jordskredsrisici vedrørende de forskellige områder på Frankrigs territorium. |
| C0460/R1970 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Jordskred i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskredsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0460/R1960. |
| Naturkatastroferisici — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring | | |
| C0470/R2000 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringselskabet det følgende år skal tjene, for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, ikkeproportional ejendomsgenforsikring, bortset fra ikkeproportionale genforsikringsforpligtelser i tilknytning til forsikringsforpligtelser omfattet af branche 9 og 21. Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler. |
| C0480/R2000 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkravet før risikoreduktion for ikkeproportional ejendomsgenforsikring. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0490/R2000 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0500/R2000 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |
| C0510/R2000 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Motoransvar</i> | | |
| C0520/R2100 | Antal køretøjer — policegrænse over 24 mio. EUR | Antal køretøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, motoransvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, med en vurderet policegrænse på over 24 000 000 EUR. |
| C0530/R2100 | Antal køretøjer — policegrænse under eller lig med 24 mio. EUR | Antal køretøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, motoransvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, med en vurderet policegrænse på under eller lig med 24 000 000 EUR. |
| C0540/R2100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til motoransvarsforsikring. |
| C0550/R2100 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0560/R2100 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring. |
| C0570/R2100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| C0610/R2200 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0620/R2200 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0630/R2200 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0640/R2200 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision efter risikoreduktion | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0650/R2200 | Fartøjets navn | Navnet på det pågældende fartøj. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion</i> | | |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| C0660–C0700/ R2300 | Kapitalkrav for katastroferisiko i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion — <i>Dæknings-type</i> — før risikoreduktion | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype (skade på ejendom, fjernelse af vragester, tab af produktionsindtægter, afdækning eller sikring af borehullet, ansvarsforsikring og genforsikringsforpligtelser), vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion.</p> <p>Maksimum vedrører alle offshore olie- og gasplatforme, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet med hensyn til platformskollision i følgende brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og — ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring <p>Beløbet pr. dækningstype er lig med forsikringssummen for den specifikke dækningstype accepteret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet vedrørende den valgte platform.</p> |
| C0710/R2300 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0720/R2300 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0730/R2300 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0740/R2300 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0750/R2300 | Platformens navn | Navnet på den pågældende platform. |
| <i>Antal fartøjer</i> | | |
| C0781/R2421 | Antal fartøjer under tærsklen på 250 000 EUR | Det antal fartøjer, der befinder sig under tærsklen på 250 000 EUR |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Søforsikring</i> | | |
| C0760/R2400 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0760/R2410 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for søforsikringsrisici. |
| C0760/R2420 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |
| C0770/R2400 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til søforsikringsrisici. |
| C0780/R2400 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |
| C0780/R2410 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for søforsikringsrisici. |
| C0780/R2420 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |
| Menneskeskabte katastroferisici — Luftfart | | |
| C0790–C0800/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisiko i tilknytning til luftfart før risikoreduktion — Dækningsstype — før risikoreduktion | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype (kaskoforsikring og ansvarsforsikring), for risici i tilknytning til luftfart.</p> <p>Maksimum vedrører alle luftfartøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet i følgende brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35,:</p> <ul style="list-style-type: none"> — luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og — ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring <p>Beløbet pr. dækningstype er lig med forsikringssummen for den specifikke dækningstype accepteret af forsikrings- eller genforsikringsselskabet vedrørende luftfartsforsikring og -genforsikring og i tilknytning til det valgte luftfartøj.</p> |
| C0810/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0820/R2500 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til luftfart, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0830/R2500 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |
| C0840/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart efter risikoreduktion — I alt (række) | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Brand</i> | | |
| C0850/R2600 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand før risikoreduktion | <p>Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til brandrisici.</p> <p>Dette beløb er lig med et forsikrings- eller genforsikringsselskabs største brandrisikokoncentration, dvs. det sæt bygninger med den største forsikringssum, der opfylder følgende betingelser:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Forsikrings- eller genforsikringsselskabet har forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser i brancherne, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forsikring mod brand og anden skade på ejendom, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, vedrørende de enkelte bygninger, som dækker skade som følge af brand eller eksplosion, herunder som følge af terrorangreb. — Alle bygninger ligger helt eller delvist inden for en radius af 200 meter. |
| C0860/R2600 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til brand, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0870/R2600 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til brand. |
| C0880/R2600 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand efter risikoreduktion | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til brand. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| | Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | |
| C0890/R2700–R2740 | Præmieindtægter følgende 12 måneder — Dækningstype | <p>Forsikrings- eller genforsikringskoncernens præmieindtægter, pr. dækningstype, i de efterfølgende 12 måneder vedrørende forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for ansvarsrisiko, for følgende dækningstyper:</p> <ul style="list-style-type: none"> — erhvervsansvarsforsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen erhvervsansvarsforsikring og -genforsikring for selvstændige håndværkere — forsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende arbejdsgiveransvar — forsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende bestyrelsesansvar — Ansvarsforsikrings- og ansvarsforsikringsforpligtelser, der indgår i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, almindelig ansvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen forpligtelser, der er omfattet af ansvarsrisikogruppe 1-3, og undtagen personlig ansvarsforsikring og proportional genforsikring og undtagen erhvervsansvarsforsikring og -genforsikring for selvstændige håndværkere — ikkeproportional genforsikring. <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0890/R2750 | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder — I alt | Forsikrings- eller genforsikrings-selskabets præmieindtægter i alt for alle dækningstyper, i de efterfølgende 12 måneder. |
| C0900/R2700–R2740 | Højeste ydede ansvarsgrænse — Dækningstype | Højeste ansvarsgrænse, pr. dækningstype, ydet af forsikrings- eller genforsikrings-selskabet vedrørende ansvarsrisici. |
| C0910/R2700–R2740 | Antal krav — Dækningstype | Antal krav pr. dækningstype — er lig med det laveste heltal, der overstiger den ved den givne formel beregnede størrelse. |
| C0920/R2700–R2740 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — Dækningstype | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype, for ansvarsrisici. |
| C0920/R2750 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt | Kapitalkrav i alt for alle dækningstyper før risikoreduktion vedrørende ansvarsrisici. |
| C0930/R2700–R2740 | Skønnet risikoreduktion — Dækningstype | Den skønnede risikoreducerende virkning, pr. dækningstype, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til ansvar, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0930/R2750 | Skønnet risikoreduktion — I alt | Skønnet risikoreduktion i alt for alle dækningstyper. |
| C0940/R2700–R2740 | Skønnede genindsættelsespræmier — Dækningstype | De skønnede genindsættelsespræmier, pr. dækningstype, vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0940/R2750 | Skønnede genindsættelsespræmier — I alt | Skønnede genindsættelsespræmier i alt for alle dækningstyper. |
| C0950/R2700–R2740 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — Dækningstype | Kapitalkrav, pr. dækningstype, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0950/R2750 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt | Det samlede kapitalkrav for alle dækningstyper, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0960/R2800 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| C0960/R2810 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — Diversifikation mellem dækningstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige dækningstyper for ansvarsrisici. |
| C0960/R2820 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| C0970/R2800 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den skønnede risikoreduktion i alt, før diversifikationseffekten mellem dækningstyper, for ansvarsrisici. |
| C0980/R2800 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| C0980/R2810 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — Diversifikation mellem dækningstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige dækningstyper for ansvarsrisici. |
| C0980/R2820 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| | Menneskeskabte katastroferisici — Kredit og kaution | |
| C0990/R2900–R2910 | Eksposering (på individuelt niveau eller koncernniveau) — Største eksposering | Forsikrings- eller genforsikringsselskabets to største bruttokreditforsikringseksponeringer på grundlag af en sammenligning af nettotabet givet misligholdelse af kreditforsikringseksponeringerne, hvilket er lig med tabet givet misligholdelse efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0990/R2920 | Eksposering (på individuelt niveau eller koncernniveau) — I alt | Forsikrings- eller genforsikringsselskabets to største bruttokreditforsikringseksponeringer i alt på grundlag af en sammenligning af nettotabet givet misligholdelse af kreditforsikringseksponeringerne, hvilket er lig med tabet givet misligholdelse efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C1000/R2900–R2910 | Andel af skade forårsaget af scenario — Største eksposering | Den procentvise andel af tab givet misligholdelse i forhold til bruttokrediteksponeringen uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, for hver af forsikrings- eller genforsikringsselskabets to største bruttokreditforsikringseksponeringer. |
| C1000/R2920 | Andel af skade forårsaget af scenario — I alt | Gennemsnitligt tab givet misligholdelse for de to største bruttokrediteksponeringer uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C1010/R2900–R2910 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — Største eksposering | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. største eksposering, vedrørende scenariet stor kreditmisligholdelse i tilknytning til kredit- og kautionrisici. |
| C1010/R2920 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — I alt | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende scenariet stor kreditmisligholdelse i tilknytning til kredit- og kautionrisici. |
| C1020/R2900–R2910 | Skønnet risikoreduktion — Største eksposering | Den skønnede risikoreducerende virkning, pr. største eksposering, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1020/R2920 | Skønnet risikoreduktion — I alt | Den skønnede risikoreducerende virkning, for de to største eksposeringer, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C1030/R2900–R2910 | Skønnede genindsættelsespræmier — Største eksponering | De skønnede genindsættelsespræmier, pr. største eksponering, for selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1030/R2920 | Skønnede genindsættelsespræmier — I alt | De skønnede genindsættelsespræmier, for de to største eksponeringer, for selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1040/R2900–R2910 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — Største eksponering | Nettokapitalkrav, pr. største eksponering, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1040/R2920 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — I alt | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1050/R3000 | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Forsikrings- eller genforsikringsselskabets bruttopræmieindtægter de efterfølgende 12 måneder i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, kredit- og kautionsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser. |
| C1060/R3000 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Recessionsrisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende scenariet recessionsrisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici. |
| C1070/R3000 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1080/R3000 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1090/R3000 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Recessionsrisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1100/R3100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| C1100/R3110 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav for risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for kredit- og kautionsrisici. |
| C1100/R3120 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| C1110/R3100 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3110 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3120 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| Menneskeskabte katastroferisici — Andre skadesforsikringskatastroferisici | | |
| C1130/R3200–R3240 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Forpligtelsesgruppe | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikrings-selskabet det følgende år skal tjene for så vidt angår kontrakter vedrørende følgende forpligtelsesgrupper:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen søforsikring og -genforsikring og luftfartsforsikring og -genforsikring — Genforsikringsforpligtelser inden for brancherne, ikkeproportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring, undtagen søgenforsikring og luftfartsgenforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for branchen diverse økonomiske tab, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen udvidede garantiforsikrings- og -genforsikringsforpligtelser, forudsat at porteføljen af disse forpligtelser er meget diversificeret, og disse forpligtelser ikke omfatter udgifterne til produkttilbagekaldelser — Genforsikringsforpligtelser inden for brancherne, ikkeproportional ulykkesgenforsikring, undtagen almindelig ansvarsgenforsikring — ikkeproportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende forsikringsforpligtelser inden for branchen kredit- og kauforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser. <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C1140/R3200–R3240 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — Forpligtelsesgruppe | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. forpligtelsesgruppe, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3250 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3260 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige forpligtelsesgrupper inden for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3270 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1150/R3250 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede skønnede risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3250 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3260 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige forpligtelsesgrupper inden for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3270 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| | Sygeforsikringskatakroferisici | |
| | Sygeforsikringskatakroferisici — Masseulykker | |
| C1170/R3300–R3600, C1190/R3300–R3600, C1230/R3300–R3600, C1250/R3300–R3600 | Forsikringstagere — <i>pr. begivenhedstype</i> | Alle forsikrings- eller genforsikringsselskabets forsikrede, som er indbyggere i hvert af landene og er forsikret mod følgende begivenhedstyper: <ul style="list-style-type: none"> — Dødsfald forårsaget af en ulykke — Permanent invaliditet forårsaget af en ulykke — Invaliditet, som varer 12 måneder, forårsaget af en ulykke — Medicinsk behandling i tilknytning til en ulykke. |
| C1180/R3300–R3600, C1200/R3300–R3600, C1240/R3300–R3600, C1260/R3300–R3600 | Værdi af ydelser, som skal betales — <i>pr. begivenhedstype</i> | Værdi af ydelserne er forsikringssummen eller, hvis forsikringsaftalen omfatter tilbagevendende ydelsesbetalinger, det bedste skøn over ydelsesbetalingerne, beregnet ved hjælp af cash flow-fremskrivning, <i>pr. begivenhedstype</i> . Hvis ydelserne i henhold til en forsikringsaftale afhænger af arten eller omfanget af en skade som følge af begivenhedstyper, baseres beregningen af værdien af ydelserne på de højeste ydelser, som kan opnås i henhold til aftalen, og som stemmer overens med begivenheden. For forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling baseres værdien af ydelserne på et skøn over det gennemsnitlige beløb, der udbetales i tilfælde af begivenhedstyper, idet der tages højde for de specifikke garantier, som forpligtelserne omfatter. |
| C1270/R3300–R3600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkrav før risikoreduktion, for hvert af landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1270/R3610 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1270/R3620 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser vedrørende de forskellige lande. |
| C1270/R3630 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1280/R3300–R3600 | Skønnet risikoreduktion | For hvert land den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C1280/R3610 | Skønnet risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1290/R3300–R3600 | Skønnede genindsættelsespræmier | For hvert land de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C1290/R3610 | Skønnede genindsættelsespræmier — Masseulykkesrisici i alt for alle lande før diversifikation | De samlede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1300/R3300–R3600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser, for hvert land. |
| C1300/R3610 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1300/R3620 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser vedrørende de forskellige lande. |
| C1300/R3630 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C1300/R3620. |
| | <i>Sygeforsikrings-katastroferisici — Ulykkeskoncentration</i> | |
| C1310/R3700–R4010 | Største kendte ulykkesrisikokoncentration — Lande | <p>Et forsikrings- eller genforsikringsselskabs største ulykkesrisikokoncentration, for hvert land, er lig med det højeste antal personer, for hvilke alle følgende betingelser er opfyldt:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Forsikrings- eller genforsikringsselskabet har en arbejdsskadeforsikrings- eller arbejdsskadegenforsikringsforpligtelse eller en gruppeforsikrings- eller gruppegenforsikringsforpligtelse for indkomstsikring vedrørende de enkelte personer — Forpligtelserne vedrørende de enkelte personer dækker mindst én af de i følgende post fastsatte betingelser — Personerne arbejder i den samme bygning, som ligger i dette bestemte land. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| | | <p>Disse personer er forsikret mod følgende begivenhedstyper:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Dødsfald forårsaget af en ulykke — Permanent invaliditet forårsaget af en ulykke — Invaliditet, som varer 10 år, forårsaget af en ulykke — Invaliditet, som varer 12 måneder, forårsaget af en ulykke — Medicinsk behandling i tilknytning til en ulykke. |
| C1320/R3700–R4010, C1330/R3700–R4010, C1350/R3700–R4010, C1360/R3700–R4010 | Gennemsnitlig forsikringssum pr. begivenhedstype | Den gennemsnitlige værdi af ydelser, der skal betales af forsikrings- og genforsikringselskaber for den største ulykkesrisikokonzentration. |
| C1370/R3700–R4010 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkravet før risikoreduktion, for hvert land, i tilknytning til delmodul for ulykkeskonzentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1410 | Andre lande, der skal indgå i ulykkeskonzentrationen | Angiv ISO-koden for andre lande, der skal indgå i ulykkeskonzentrationen. |
| C1370/R4020 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Ulykkeskonzentration i alt — Alle lande før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem lande, for delmodul for ulykkeskonzentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1370/R4030 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af delmodul for ulykkeskonzentration vedrørende sygeforsikringsrisici vedrørende de forskellige lande. |
| C1370/R4040 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Ulykkeskonzentration i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem lande, for delmodul for ulykkeskonzentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1380/R3700–R4010 | Skønnet risikoreduktion — Lande | For hvert af de pågældende lande den skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1380/R4020 | Skønnet risikoreduktion — Ulykkeskonzentration i alt — Alle lande før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| C1390/R3700–R4010 | Skønnede genindsættelsespræmier — Lande | For hvert af de pågældende lande de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C1390/R4020 | Skønnede genindsættelsespræmier — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | De samlede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1400/R3700–R4010 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Lande | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici for hvert af de pågældende lande. |
| C1400/R4020 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem lande, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1400/R4030 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici for de forskellige lande. |
| C1400/R4040 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C1400/R4020. |
| Sygeforsikrings-katastroferisici — Pandemirisici | | |
| C1440/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Antal forsikrede — Lande | Forsikrings- og genforsikringsselskabers antal forsikrede, for hvert af de pågældende lande, som opfylder følgende betingelser: <ul style="list-style-type: none"> — De forsikrede er indbyggere i det pågældende land. — De forsikrede er dækket af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for udgifter til lægebehandling, som ikke er arbejdsskadeforsikrings- eller -genforsikringsforpligtelser, der dækker udgifter til lægebehandling som følge af en smitsom sygdom. Disse forsikrede kan begære ydelser for følgende typer sundhedspleje: <ul style="list-style-type: none"> — Hospitalsindlæggelse — Konsultation hos en almenpraktiserende læge — Ingen formel lægelig behandling opsøgt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| C1450/R4100–R4410, C1470/R4100–R4410, C1490/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Enhedserstatningsudgifter pr. type sundhedspleje — Lande | Bedste skøn over de beløb, beregnet ved hjælp af cash flow-fremskrivning, som forsikrings- og genforsikringsselskaber skal betale for en forsikret vedrørende forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for udgifter til lægebehandling, som ikke er arbejdsskedeforsikrings- eller -genforsikringsforpligtelser, alt efter den anvendte sundhedspleje, i tilfælde af en pandemi, for hvert af de pågældende lande. |
| C1460/R4100–R4410, C1480/R4100–R4410, C1500/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Andelen af forsikrede, pr. type sundhedspleje — Lande | Andelen af forsikrede med kliniske symptomer, pr. type sundhedspleje, for hvert af de pågældende lande. |
| C1510/R4100–R4410 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Lande | Kapitalkravet før risikoreduktion, for hvert af de pågældende lande, i tilknytning til delmodulet for pandemirisici vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1550 | Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | Angiv ISO-koden for andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici. |
| C1420/R4420 | Indkomstsikring — Antal forsikrede — Pandemirisici i alt for alle lande | Samlet antal forsikrede for alle de pågældende lande, som er dækket af andre forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for indkomstsikring end arbejdsskade- eller arbejdsskade-genforsikringsforpligtelser. |
| C1430/R4420 | Indkomstsikring — Samlet eksponering vedrørende pandemirisici — Pandemirisici i alt for alle lande | Forsikrings- og genforsikringsselskabers samlede eksponering vedrørende indkomstsikring i tilknytning til pandemirisici for alle de pågældende lande. Værdi af ydelserne, der skal betales for den forsikrede, er forsikringssummen eller, hvis forsikringsaftalen omfatter tilbagevendende ydelsesbetalinger, det bedste skøn over ydelsesbetalingerne, idet det antages, at den sikrede er permanent invalideret og ikke vil komme sig. |
| C1510/R4420 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til delmodulet for pandemirisici vedrørende sygeforsikringsrisici for alle de pågældende lande. |
| C1520/R4420 | Skønnet risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Den samlede skønnede risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier, for alle de pågældende lande. |
| C1530/R4420 | Skønnede genindsættelsespræmier — Pandemirisici i alt for alle lande | De samlede skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko for alle de pågældende lande. |
| C1540/R4420 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til delmodulet for pandemirisici vedrørende sygeforsikringsrisici for alle de pågældende lande. |

S.28.01 — Minimumskapitalkrav — udelukkende livsforsikrings- eller livsgenforsikringsvirksomhed eller udelukkende skadesforsikrings- eller skadesgenforsikringsvirksomhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den indledende, kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Skema S.28.01 skal indberettes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, bortset fra forsikringsselskaber, der udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed. Disse selskaber skal i stedet indberette skema S.28.02.

Dette skema skal udfyldes på grundlag af Solvens II-værdiansættelsen, dvs. at tegnede præmier defineres som præmier, der skal indbetales til selskabet i løbet af perioden (jf. artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35).

Ved forsikringsmæssige hensættelser forstås forsikringsmæssige hensættelser efter anvendelse af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.

Beregningen af minimumskapitalkravet kombinerer en lineær formel med en bundgrænse på 25 % og et loft på 45 % af solvenskapitalkravet. Minimumskapitalkravet er omfattet af en absolut bundgrænse, afhængigt af selskabets art (jf. artikel 129, stk. 1, litra d), i direktiv 2009/138/EF.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Lineært formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav _{NL} Resultat | Det lineære formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser beregnet i henhold til artikel 250 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0020/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0030/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0030/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0100 | Kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0100 | Kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0020/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |
| C0030/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0020/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0030/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0040/R0200 | Lineært formelement for livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav _L Resultat | Resultatet af det lineære formelement for livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser beregnet i henhold til artikel 251 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0050/R0210 | Forpligtelser med gevinstandele — garanterede ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for garanterede ydelser for livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, og forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for genforsikringsforpligtelser, hvor de underliggende livsforsikringsforpligtelser omfatter gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul. |
| C0050/R0220 | Forpligtelser med gevinstandele — fremtidige diskretionære ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser for livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul. |
| C0050/R0230 | Indeksregulerede og unit-linked forsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for indeksregulerede og unit-linked livsforsikringsforpligtelser og genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul. |
| C0050/R0240 | Andre livs- og sygeforsikringsforpligtelser og livs- og syge-genforsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for alle andre livs- og livs-genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul. Annuiteter vedrørende skadesforsikringsaftaler indberettes her. |
| C0060/R0250 | Risikosum i alt for alle livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser — samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) | Den samlede risikosum, dvs. summen af risikosummen i tilknytning til alle aftaler, som medfører livsforsikrings- eller livs-genforsikringsforpligtelser. |
| C0070/R0300 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Lineært minimumskapitalkrav | Det lineære minimumskapitalkrav er lig med summen af minimumskapitalkravets lineære formelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser og minimumskapitalkravets lineære formelement for livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser beregnet i henhold til artikel 249 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0070/R0310 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Solvenskapitalkrav | Det seneste beløb for solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes i henhold til artikel 103-127 i direktiv 2009/138/EF, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at solvenskapitalkravet er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), herunder et kapitaltillæg. Selskaber, der anvender en intern model eller en partiel intern model til beregning af solvenskapitalkravet, skal anvende det relevante solvenskapitalkrav, undtagen hvis den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF kræver, at standardformlen anvendes. |
| C0070/R0320 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Loft for minimumskapitalkrav | Dette beregnes som 45 % af solvenskapitalkravet, inklusive et eventuelt kapitaltillæg i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0070/R0330 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Bundgrænse for minimumskapitalkrav | Dette beregnes som 25 % af solvenskapitalkravet, inklusive et eventuelt kapitaltillæg i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0070/R0340 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Kombineret minimumskapitalkrav | Resultatet af formelelementet beregnet i henhold til artikel 248, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0070/R0350 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Absolut bundgrænse for minimumskapitalkravet | Dette beregnes som anført i artikel 129, stk. 1, litra d), i direktiv 2009/138/EF. |
| C0070/R0400 | Minimumskapitalkrav | Resultatet af formelelementet beregnet i henhold til artikel 248, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.28.02 — Minimumskapitalkrav — både livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den indledende, kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Skema S.28.02 skal indberettes af forsikringsselskaber, der udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed. Andre forsikrings- og genforsikringsselskaber end forsikringsselskaber, der udøver både livs- og skadesforsikringsvirksomhed, skal i stedet indberette skema S.28.01.

Dette skema skal udfyldes på grundlag af Solvens II-værdiansættelsen, dvs. at tegnede præmier defineres som præmier, der skal indbetales til selskabet i løbet af perioden (jf. artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35.

Forsikrings- og genforsikringsselskaber oplyser tegnede præmier/præmieindtægter som defineret i artikel 1, nr. 11) og 12), i delegeret forordning (EU) 2015/35, uanset om der er anvendt lokal GAAP eller IFRS. Ved forsikringsmæssige hensættelser forstås forsikringsmæssige hensættelser efter anvendelse af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.

Beregningen af minimumskapitalkravet kombinerer en lineær formel med en bundgrænse på 25 % og et loft på 45 % af solvenskapitalkravet. Minimumskapitalkravet er omfattet af en absolut bundgrænse, afhængigt af selskabets art (jf. artikel 129, stk. 1, litra d), i direktiv 2009/138/EF.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0010 | Lineært formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav _(NL,NL) resultat — skadesforsikringsvirksomhed | Det lineære formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser i tilknytning til skadesforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 4 og 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0020/R0010 | Lineært formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav ^(NL,L) resultat | Det lineære formelelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser i tilknytning til livsforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 9 og 10, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0030/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0020 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0060/R0030 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0040 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende arbejdsskade i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0050/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0050 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende motoransvar i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0060 | Anden motorforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til anden motorforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0040/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0070 | Luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til luftfarts-, sø- og transportforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0080 | Forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring mod brand og anden skade på ejendom i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0030/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0090 | Almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til almindelig ansvarsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0100 | Kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0100 | Kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0100 | Kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til kredit- og kaufionsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0060/R0100 | Kredit- og kauforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til kredit- og kauforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0110 | Retshjælpsforsikring og proportional genforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til retshjælpsforsikring og proportional genforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til assistance og proportional genforsikring vedrørende assistance, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0050/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0120 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende assistance i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0130 | Forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til forsikring og proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0030/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0140 | Ikkeproportional sygegenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional sygegenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0150 | Ikkeproportional ulykkesgenforsikring — Tegnede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ulykkesgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0030/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0160 | Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0030/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0040/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — skadesforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0050/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring, uden risikomargin, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0060/R0170 | Ikkeproportional ejendomsforsikring — Tegnedede præmier de seneste 12 måneder, netto (dvs. med fradrag af genforsikring) — livsforsikringsvirksomhed | De tegnede præmier i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring i løbet af de seneste 12 måneder, efter fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, med en bundgrænse på nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0070/R0200 | Lineært formeelement for livsforsikrings- og -livsgenforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav _(L, NL) Resultat | Det lineære formeelement for livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser i tilknytning til skadesforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 4 og 5, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0080/R0200 | Lineært formeelement for livsforsikrings- og -livsgenforsikringsforpligtelser — Minimumskapitalkrav _(L, L) Resultat | Det lineære formeelement for livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser i tilknytning til livsforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 9 og 10, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0090/R0210 | Forpligtelser med gevinstandele — garanterede ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for garanterede ydelser for livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, i tilknytning til livsforsikringsvirksomhed, og forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for genforsikringsforpligtelser, hvor de underliggende forsikringsforpligtelser omfatter gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0110/R0210 | Forpligtelser med gevinstandele — garanterede ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for garanterede ydelser for livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, i tilknytning til livsforsikringsvirksomhed, og forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for genforsikringsforpligtelser, hvor de underliggende forsikringsforpligtelser omfatter gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0090/R0220 | Forpligtelser med gevinstandele — fremtidige diskretionære ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser i tilknytning til livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0110/R0220 | Forpligtelser med gevinstandele — fremtidige diskretionære ydelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser i tilknytning til livsforsikringsforpligtelser med gevinstandele, efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0090/R0230 | Indeksregulerede og unit-linked forsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for indeksregulerede og unit-linked livsforsikringsforpligtelser og genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0110/R0230 | Indeksregulerede og unit-linked forsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for indeksregulerede og unit-linked livsforsikringsforpligtelser og genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0090/R0240 | Andre livs- og sygeforsikringsforpligtelser og livs- og sygegenforsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for andre livsforsikringsforpligtelser og genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende skadesforsikringsvirksomhed. |
| C0110/R0240 | Andre livs- og sygeforsikringsforpligtelser og livs- og sygegenforsikringsforpligtelser — Bedste skøn og forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | De forsikringsmæssige hensættelser uden en risikomargin for andre livsforsikringsforpligtelser og genforsikringsforpligtelser relateret til sådanne forsikringsforpligtelser efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0100/R0250 | Risikosum i alt for alle livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser — samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — skadesforsikringsvirksomhed | Risikosum i alt, dvs. summen for alle aftaler, som medfører livsforsikrings- eller livs-genforsikringsforpligtelser, af de højeste beløb, som forsikrings-selskabet skal betale i tilfælde af de af aftalen omfattede forsikredes død eller invaliditet, efter fradrag af de beløb, der i givet fald kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er, og den forventede nutidsværdi af annuiteter, der skal betales ved død eller invaliditet, minus det bedste nettoskøn, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0120/R0250 | Risikosum i alt for alle livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser — samlet risikosum, netto (dvs. med fradrag af genforsikring/SPV'er) — livsforsikringsvirksomhed | Risikosum i alt, dvs. summen for alle aftaler, som medfører livsforsikrings- eller livs-genforsikringsforpligtelser, af de højeste beløb, som forsikrings-selskabet skal betale i tilfælde af de af aftalen omfattede forsikredes død eller invaliditet, efter fradrag af de beløb, der i givet fald kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, og den forventede nutidsværdi af annuiteter, der skal betales ved død eller invaliditet, minus det bedste nettoskøn, med en bundgrænse lig med nul, vedrørende livsforsikringsvirksomhed. |
| C0130/R0300 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Lineært minimumskapitalkrav | Det lineære minimumskapitalkrav er lig med summen af minimumskapitalkravets lineære formelement for skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser og minimumskapitalkravets lineære formelement for livsforsikrings- og livs-genforsikringsforpligtelser beregnet i henhold til artikel 249 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0130/R0310 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Solvenskapitalkrav | Det seneste beløb for solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes i henhold til artikel 103-127 i direktiv 2009/138/EF, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at solvenskapitalkravet er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), herunder et kapitaltillæg. Selskaber, der anvender en intern model eller en partiel intern model til beregning af solvenskapitalkravet, skal anvende det relevante solvenskapitalkrav, undtagen hvis den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF kræver, at standardformlen anvendes. |
| C0130/R0320 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Loft for minimumskapitalkrav | Dette beregnes som 45 % af solvenskapitalkravet, inklusive et eventuelt kapitaltillæg i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0130/R0330 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Bundgrænse for minimumskapitalkrav | Dette beregnes som 25 % af solvenskapitalkravet, inklusive et eventuelt kapitaltillæg i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0130/R0340 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Kombineret minimumskapitalkrav | Resultatet af formelelementet beregnet i henhold til artikel 248, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0130/R0350 | Beregning af det samlede minimumskapitalkrav — Absolut bundgrænse for minimumskapitalkravet | Det er beregnet som defineret i artikel 129, stk. 1, litra d), i direktiv 2009/138/EF, og artikel 253 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0130/R0400 | Minimumskapitalkrav | Resultatet af formelelementet beregnet i henhold til artikel 248, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0140/R0500 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk lineært minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Dette beregnes i henhold til artikel 252, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0500 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk lineært minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Dette beregnes i henhold til artikel 252, stk. 9, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0140/R0510 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg (for året eller seneste beregning) — Skadesforsikringsvirksomhed | Det seneste teoretiske solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes i henhold til artikel 103-127 i direktiv 2009/138/EF, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at det teoretiske solvenskapitalkrav er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), eksklusiv et kapitaltillæg. Selskaber, der anvender en intern model eller en partiel intern model til beregning af solvenskapitalkravet, skal anvende det relevante solvenskapitalkrav, undtagen hvis den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF kræver, at standardformlen anvendes. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0150/R0510 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk solvenskapitalkrav eksklusive kapitaltillæg (for året eller seneste beregning) — Livsforsikringsvirksomhed | Det seneste teoretiske solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes i henhold til artikel 103-127 i direktiv 2009/138/EF, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at det teoretiske solvenskapitalkrav er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), eksklusive et kapitaltillæg. Selskaber, der anvender en intern model eller en partiel intern model til beregning af solvenskapitalkravet, skal anvende det relevante solvenskapitalkrav, undtagen hvis den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF kræver, at standardformlen anvendes. |
| C0140/R0520 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Loft for teoretisk minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Dette beregnes som 45 % af det teoretiske solvenskapitalkrav for skadesforsikringsvirksomhed, inklusive skadesforsikringskapitaltillægget i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0150/R0520 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Loft for teoretisk minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Dette beregnes som 45 % af det teoretiske solvenskapitalkrav for livsforsikringsvirksomhed, inklusive livsforsikringskapitaltillægget i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0140/R0530 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Bundgrænse for teoretisk minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Dette beregnes som 25 % af det teoretiske solvenskapitalkrav for skadesforsikringsvirksomhed, inklusive skadesforsikringskapitaltillægget i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0150/R0530 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Bundgrænse for teoretisk minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Dette beregnes som 25 % af det teoretiske solvenskapitalkrav for livsforsikringsvirksomhed, inklusive livsforsikringskapitaltillægget i henhold til artikel 129, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF. |
| C0140/R0540 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk kombineret minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Dette beregnes i henhold til artikel 252, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0150/R0540 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk kombineret minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Dette beregnes i henhold til artikel 252, stk. 8, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0140/R0550 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Absolut bundgrænse for det teoretiske minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Det er beløbet som defineret i artikel 129, stk. 1, litra d), nr. i), i direktiv 2009/138/EF, inden artikel 253 i delegeret forordning (EU) 2015/35 er taget i betragtning. |
| C0150/R0550 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Absolut bundgrænse for det teoretiske minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Det er beløbet som defineret i artikel 129, stk. 1, litra d), nr. ii), i direktiv 2009/138/EF, inden artikel 253 i delegeret forordning (EU) 2015/35 er taget i betragtning. |
| C0140/R0560 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk minimumskapitalkrav — skadesforsikringsvirksomhed | Det teoretiske minimumskapitalkrav for skadesforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0150/R0560 | Beregning af det teoretiske minimumskapitalkrav for skades- og livsforsikring — Teoretisk minimumskapitalkrav — livsforsikringsvirksomhed | Det teoretiske minimumskapitalkrav for livsforsikringsvirksomhed beregnet i henhold til artikel 252, stk. 7, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.29.01 — Overskydende aktiver i forhold til passiver

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema vedrører ikke captive-forsikrings- og -genforsikringsselskaber, der opfylder betingelserne i forordningen.

Dette skema forklarer, sammen med skema S.29.02 til S.29.04, ændringerne i overskydende aktiver i forhold til passiver, idet de forskellige kilder til bevægelser sammenholdes (se venligst de fem vigtigste kilder under b) nedenfor). I disse skemaer skal værdiskabelse indberettes (f.eks. indtægter fra investeringer).

Indholdet i dette skema omfatter:

- a) En præsentation af alle ændringer i basiskapitalgrundlagselementer i indberetningsperioden. Her isoleres ændringerne i overskydende aktiver i forhold til passiver, som en del af disse ændringer. Den første analyse foretages udelukkende på grundlag af oplysninger, der også indberettes i skema S.23.01 (år N og N-1).
- b) Oversigt over de 5 hovedkilder til ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver mellem den foregående og den sidste indberetningsperiode (celle C0030/R0190-C0030/R0250):
 - Ændringerne i tilknytning til investeringer og finansielle forpligtelser — nærmere beskrevet i skema S.29.02
 - Ændringerne i tilknytning til forsikringsmæssige hensættelser — nærmere beskrevet i skema S.29.03 og S.29.04
 - Ændringerne i »rene« kapitalposter, som ikke er direkte påvirket af driften (f.eks. ændringer i ordinære aktiers antal og værdi); disse ændringer analyseres nærmere i skema S.23.03
 - Andre væsentlige ændringer i tilknytning til skat og dividendeudlodning, nærmere bestemt:
 - Ændringer vedrørende udskudt skat

- Indkomstskat i indberetningsperioden
- Dividendeudlodning
- Andre ændringer, ikke forklaret andetsteds.

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------|---|---|
| C0010/R0010–R0120 | Basiskapitalgrundlagselementer — År N | Disse poster omfatter ikke alle basiskapitalgrundlagselementer, men kun sådanne før justeringer/fradrag for: <ul style="list-style-type: none"> — Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — Kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter. |
| C0020/R0010 — R0120 | Basiskapitalgrundlagselementer — År N-1 | Disse poster omfatter ikke alle basiskapitalgrundlagselementer, men kun sådanne før justeringer/fradrag for: <ul style="list-style-type: none"> — Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — Kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter. |
| C0030/R0010–R0120 | Basiskapitalgrundlagselementer — Ændring | Ændring i kapitalgrundlagselementer mellem indberetningsperiode N og N-1. |
| C0030/R0130 | Overskydende aktiver i forhold til passiver (ændringer i kapitalgrundlag forklaret ved skemaer vedrørende analyse af ændringer) | Ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver. Denne post analyseres nærmere i række R0190-R0250 og dernæst i skema S29.02 til S.29.04. Overskydende aktiver i forhold til passiver behandles før fradrag for kapitalinteresser i finansierings- og kreditinstitutter. |
| C0030/R0140 | Egne aktier | Ændringer vedrørende egne aktier, der er opført i balancen. |
| C0030/R0150 | Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer | Ændringer vedrørende påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer. |
| C0030/R0160 | Andre basiskapitalgrundlagselementer | Ændringer vedrørende andre basiskapitalgrundlagselementer |
| C0030/R0170 | Begrænsede kapitalgrundlagselementer — ring fencing og matching | Ændringer vedrørende begrænsede kapitalgrundlagselementer som følge af ring fencing og matching. |
| C0030/R0180 | Ændring i alt vedrørende afstemningsreserven | Ændring i alt vedrørende afstemningsreserven. |
| C0030/R0190 | Ændringer som følge af investeringer og finansielle forpligtelser | Ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver forklaret ved ændringer i investeringer og finansielle forpligtelser (f.eks. ændringer i værdien i løbet af perioden, finansielle indtægter osv.). Beløbet omfatter ikke egne aktier. |
| C0030/R0200 | Ændringer som følge af forsikringsmæssige hensættelser, netto | Ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver forklaret ved ændringer i de forsikringsmæssige hensættelser (f.eks. tilbageførsel af hensættelser, nye præmieindtægter osv.). |
| C0030/R0210 | Ændringer i basiskapitalgrundlagselementer og andre godkendte poster | Dette beløb er et udtryk for den del af ændringen i overskydende aktiver i forhold til passiver, som skyldes bevægelser i »rene« kapitalposter, f.eks. stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier), præferenceaktier, overskudskapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0030/R0220 | Ændringer vedrørende udskudt skat | Ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, som skyldes ændringer vedrørende udskudte skatteaktiver og udskudte skatteforpligtelser. |
| C0030/R0230 | Indkomstskat i indberetningsperioden | Selskabsskat i indberetningsperioden i henhold til regnskaberne for indberetningsperioden. |
| C0030/R0240 | Dividendeudlodning | Dividendeudlodning i indberetningsperioden i henhold til regnskaberne for indberetningsperioden. |
| C0030/R0250 | Andre ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver | Resterende ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver. |

S.29.02 — Overskydende aktiver i forhold til passiver — det skyldes investeringer og finansielle forpligtelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema fokuserer på ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser.

Dette skema:

- i. omfatter investeringer
- ii. omfatter forpligtelser knyttet til derivater (som investeringer)
- iii. omfatter egne aktier
- iv. omfatter finansielle forpligtelser (herunder efterstillet gæld)
- v. omfatter ikke aktiver, der besiddes i forbindelse med unit-linked og indeksregulerede fonde
- vi. omfatter ikke ejendomme, der besiddes til eget brug.

Skemaet omfatter for så vidt angår alle disse poster de investeringer, der besiddes ultimo i den foregående indberetningsperiode (N-1), og de investeringer, der erhverves/udstedes i indberetningsperioden (N).

Skema S.29.02 (sidste tabel) adskiller sig fra oplysningerne i skema S.09.01 på den måde, at det omfatter indtægter fra egne aktier og udelukker ejendomme, der besiddes til eget brug. Skemaet har til formål at tilvejebringe en detaljeret forståelse af de ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes investeringer, i betragtning af:

- i. udsving i værdiansættelse med indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver (f.eks. realiserede gevinster og tab ved salg, men også forskelle i værdiansættelse)
- ii. indtægter udløst af investeringer
- iii. udgifter i tilknytning til investeringer (herunder renteudgifter i forbindelse med finansielle forpligtelser).

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Udsving i værdiansættelse af investeringer | Udsving i værdiansættelse af investeringer, herunder: <ul style="list-style-type: none"> — For de aktiver, som bevares i porteføljen, forskellen mellem Solvens II-værdier ved udgangen af indberetningsperioden (N) og ved begyndelsen af år (N-1). — For de investeringer, som afhændes mellem de to indberetningsperioder (herunder aktiver, der er erhvervet i løbet af indberetningsperioden), forskellen mellem salgsprisen og Solvens II-værdien pr. sidste indberetningsperiode (eller for investeringer, der er anskaffet i løbet af perioden, anskaffelsesværdien). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | | <p>— For de aktiver, der erhverves i løbet af indberetningsperioden, og som fortsat besiddes ultimo i indberetningsperioden, forskellen mellem Solvens II-ultimoværdien og anskaffelsesomkostningerne/værdien.</p> <p>Heri medregnes beløb i tilknytning til derivater, uanset om derivaterne er et aktiv eller et passiv.</p> <p>Heri medregnes ikke beløb indberettet under »Investeringsindtægter — R0040« og »Investeringsudgifter inkl. renteudgifter i forbindelse med efterstillet gæld og finansielle forpligtelser — R0050«.</p> |
| C0010/R0020 | Udsving i værdiansættelse af egne aktier | Det samme som for celle C0010/R0010, men for egne aktier. |
| C0010/R0030 | Udsving i værdiansættelse af finansielle forpligtelser og efterstillet gæld | <p>Udsving i værdiansættelse af finansielle forpligtelser og efterstillet gæld, herunder:</p> <p>— For de finansielle forpligtelser og den efterstillede gæld, der udstedes forud for indberetningsperioden, og som ikke indfries eller indløses, forskellen mellem Solvens II-værdier ved udgangen af indberetningsperioden (N) og ved begyndelsen af indberetningsperioden (N-1).</p> <p>— For de finansielle forpligtelser og den efterstillede gæld, der indfries eller indløses i løbet af indberetningsperioden, forskellen mellem indfrielses- eller indløsningsprisen og Solvens II-værdien pr. udgangen af den sidste indberetningsperiode.</p> <p>— For de finansielle forpligtelser og den efterstillede gæld, der udstedes i løbet af indberetningsperioden og ikke indfries eller indløses i løbet af perioden, forskellen mellem Solvens II-ultimoværdien og udstedelsesprisen.</p> |
| C0010/R0040 | Investeringsindtægter | Herunder udbytte, renter, leje og andre indtægter, der skyldes investeringer inden for dettes skemas anvendelsesområde. |
| C0010/R0050 | Investeringsudgifter, herunder renteudgifter i forbindelse med efterstillet gæld og finansielle forpligtelser | <p>Investeringsudgifter, herunder renteudgifter i forbindelse med efterstillet gæld og finansielle forpligtelser, herunder:</p> <p>— udgifter til forvaltning af investeringer — i tilknytning til »Investeringer« og til »Egne aktier«</p> <p>— renteudgifter i forbindelse med efterstillet gæld og finansielle forpligtelser i tilknytning til »Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter« samt »Gæld til kreditinstitutter« og »Efterstillet gæld«.</p> <p>Disse udgifter svarer til dem, der registreres og indregnes efter periodiseringsprincippet ved udgangen af perioden.</p> |
| C0010/R0060 | Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser | Samlede ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes investeringer og finansielle forpligtelser |
| C0010/R0070 | Udbytte | <p>Udbytteindtægter i indberetningsperioden, herunder ikke udbytte fra ejendomme, der besiddes til eget brug.</p> <p>Den samme definition som i S.09.01 finder anvendelse (dog ikke for omfanget af de investeringer, der skal tages i betragtning).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--------|---|
| C0010/R0080 | Renter | Renteindtægter i indberetningsperioden, herunder ikke renter fra ejendomme, der besiddes til eget brug. Den samme definition som i S.09.01 finder anvendelse (dog ikke for omfanget af de investeringer, der skal tages i betragtning). |
| C0010/R0090 | Leje | Lejeindtægter i indberetningsperioden, herunder ikke leje fra ejendomme, der besiddes til eget brug. Den samme definition som i S.09.01 finder anvendelse (dog ikke for omfanget af de investeringer, der skal tages i betragtning). |
| C0010/R0100 | Andet | Andre investeringsindtægter modtaget eller optjent ved udgangen af indberetningsåret. Finder anvendelse på andre investeringsindtægter end dem, der ikke er omfattet af celle C0010/R0070, C0010/R0080 og C0010/R0090, f.eks. gebyrer for værdipapirudlån, tilsagnsprovision mv., undtagen indtægter fra ejendomme, der besiddes til eget brug. |

S.29.03 — Overskydende aktiver i forhold til passiver — det skyldes forsikringsmæssige hensættelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema fokuserer på ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes forsikringsmæssige hensættelser. Forsikringsmæssige hensættelser omfatter risici opfanget ved bedste skøn og risikomargin samt risici opfanget ved forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et.

For så vidt angår beregningen i tabellen »Specifikation af ændring af bedste skøn« anses den rækkefølge, som cellerne angives i, ikke for at være præskriptiv for rækkefølgen i forbindelse med beregningen, når blot indholdet af de forskellige celler svarer til de pågældende cellers formål og definitionen heraf.

Selskaberne skal indberette oplysningerne ved en metode baseret på ulykkesår- eller forsikringsår i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskabet anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

Skemaet har til formål at tilvejebringe en detaljeret forståelse af ændringer i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes forsikringsmæssige hensættelser, i betragtning af:

- Ændringer af risici opfanget ved forsikringsmæssige hensættelser
- Ændringer af forsikringsmæssige strømme i perioden
- En detaljeret specifikation af ændringen af bedste skøn — uden fradrag af genforsikring efter kilder til ændringer (f. eks. ny virksomhed, ændrede antagelser, erfaring, etc.).

Accepteret genforsikring i forbindelse med unit-linked og indeksregulerede aftaler skal medtages i skemaet.

| | POST | VEJLEDNING |
|---|-------------------|---|
| Specifikation af ændring af bedste skøn — eventuelt analyse pr. forsikringsår — uden fradrag af genforsikring | | |
| C0010–C0020/R0010 | Bedste skøn primo | Bedste skøn — med fradrag af genforsikring — som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på forsikringsår (underwriting year approach — UWY). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010–C0020/ R0020 | Usædvanlige elementer, som udløser tilpasning af bedste skøn primo | <p>Justering af det bedste skøn primo, som skyldes andre elementer end de afgrænsningsændringer, som førte til tilpasning af det bedste skøn primo.</p> <p>Vedrører hovedsagelig ændringer af modeller (hvis der anvendes modeller) med henblik på korrektion af modellen og andre ændringer. Vedrører ikke ændringer af antagelser.</p> <p>Disse celler forventes at være mest relevante for livsforsikringsvirksomhed.</p> |
| C0010–C0020/ R0030 | Afgrænsningsændringer | <p>Justering af det bedste skøn primo i tilknytning til ændringer af porteføljens afgrænsning, f.eks. salg af (en del af) porteføljen og køb. Dette kunne også vedrøre afgrænsningsændringer, som skyldes forpligtelser, der udvikler sig til annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsforpligtelser (udløser visse ændringer fra skades- til livsforsikring).</p> |
| C0010–C0020/ R0040 | Valutaændring | <p>Justering af det bedste skøn primo i tilknytning til valutaændring i løbet af perioden.</p> <p>I dette tilfælde skal valutaændringen faktisk anvendes på aftaler, som indgås i andre valutaer end balancens valuta. Ved beregningen omregnes de cash flow i forbindelse med disse aftaler, som indgår i det bedste skøn primo, blot som følge af denne valutaændring.</p> <p>Denne post omfatter ikke indvirkningen på cash flow i forbindelse med forsikringsporteføljen, der hidrører fra ny værdiansættelse af aktiver i år N-1 som følge af valutaændring i år N.</p> |
| C0010–C0020/ R0050 | Bedste skøn af risici accepteret i løbet af perioden | <p>Det afspejler den forventede nutidsværdi af fremtidige cash flow (uden fradrag af genforsikring), som indgår i det bedste skøn, og som vedrører risici accepteret i løbet af perioden.</p> <p>Det beregnes ultimo (og ikke på den faktiske forsikringsdato for de pågældende risici), dvs. det skal indgå som en del af det bedste skøn ultimo.</p> <p>Omfanget af cash flow, jf. artikel 77 i direktiv 2009/138/EF.</p> |
| C0010–C0020/ R0060 | Ændring af bedste skøn, som skyldes afvikling af diskonteringsats — risici accepteret forud for perioden | <p>Den ændring af det bedste skøn, som opfanges her, vedrører kun afviklingen af diskonteringsatser, og omfatter ikke andre parametre, f.eks. ændringer af antagelser eller diskonteringsatser, erfaringsbaseret justering osv.</p> <p>Begrebet afvikling kan illustreres som følger: Det bedste skøn for år N-1 beregnes igen, men denne gang ved brug af den ændrede rentekurve</p> <p>Ændringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Først beregnes det bedste skøn primo inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0010/R0010-R0040) — Dernæst beregnes afviklingen af diskonteringsatser på grundlag af dette tal. |
| C0010–C0020/ R0070 | Ændring af bedste skøn, som skyldes forventede ind- og udgående strømme i år N — risici accepteret forud for perioden | <p>Præmier, erstatninger og genkøb, som i det bedste skøn primo forventes betalt i løbet af året, indgår ikke længere i det bedste skøn ultimo, da de normalt er betalt/modtaget i løbet af året. Der skal foretages en udligningsjustering.</p> <p>Justeringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Først beregnes det bedste skøn primo (celle C0010/R0010) inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0010/R0020-R0040) — Dernæst afgrænses de forventede cash flow (cash in minus cash out) i det bedste skøn primo for den betragtede periode — De afgrænsede cash flow skal lægges til det bedste skøn primo (med henblik på udligning) — og angives i celle C0010/R0070 og C0020/R0070. |
| C0010–C0020/ R0080 | Ændring af bedste skøn, som skyldes erfaring — risici accepteret forud for perioden | <p>Den ændring af det bedste skøn, som angives her, vedrører kun forventede cash flow ved periodens udgang i forhold til de cash flow, der var forventede ved periodens begyndelse for perioderne N + 1 og derefter.</p> <p>Der angives kun ændringer som følge af det realiserede cash flow i år N og er ikke knyttet til ændringer i antagelser.</p> |
| C0010–C0020/ R0090 | Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer af ikkeøkonomiske antagelser — risici accepteret forud for perioden | <p>Der henvises hovedsagelig til ændringer af det bedste skøn, som ikke skyldes realiserede forsikringstekniske strømme og ændringer af antagelser, som er direkte knyttet til forsikringsrisici (dvs. optionsintensiteten), der kan betegnes som ikkeøkonomiske antagelser.</p> <p>Ændringen, som skyldes ændringer af antagelser, kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Først beregnes det bedste skøn primo (celle C0010/R0010) inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0010/R0010-R0040) og indvirkningen af afvikling for forventede cash flow i år N (henholdsvis C0010/R0060-R0080 og C0020/R0060-R0080) — På grundlag af dette tal foretages der dernæst beregninger med nye antagelser, der ikke er knyttet til diskonteringsratser — som fandt anvendelse ultimo år N (hvis det er relevant). <p>Herved fremkommer den ændring af det bedste skøn, som kun vedrører ændringer af disse antagelser. Herved opfanges muligvis ikke den ændring, der skyldes ændring fra sag til sag af indtrufne, men endnu ikke anmeldte krav, som derfor ville skulle lægges til beløbet.</p> <p>I forbindelse med skadesforsikring kan det forventes, at disse ændringer i nogle tilfælde ikke kan skelnes fra ændringer, som skyldes erfaring (C0020/R0080). I sådanne tilfælde indberettes hele beløbet under C0020/R0080.</p> |
| C0010–C0020/ R0100 | Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer i det økonomiske miljø — risici accepteret forud for perioden | <p>Der henvises hovedsagelig til antagelser, som ikke er direkte relateret til forsikringsrisici, dvs. hovedsagelig indvirkningen af ændringerne i det økonomiske miljø på cash flow (der tages højde for fremtidige ledelseshandlinger, f.eks. reduktion i de fremtidige diskretionære ydelser) og ændringer af diskonteringsratser.</p> <p>Hvis ændringer i forbindelse med skadeserstatning (C0020/R0100), som skyldes inflation, ikke kan skelnes fra ændringer, som skyldes erfaring, indberettes det samlede beløb under C0020/R0080.</p> <p>Ændringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | | <p>— Først beregnes det bedste skøn primo inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0010/R0010-R0040) og indvirkningen af afvikling for forventede cash flow og erfaring i år N (henholdsvis C0010/R0060-R0080 og C0020/R0060-R0080 eller alternativt C0010/R0060-R0090 og C0020/R0060-R0090)</p> <p>— På grundlag af dette tal foretages der dernæst beregninger med nye diskonteringssatser, som fandt anvendelse i løbet af år N, sammen med relaterede finansielle antagelser (hvis det er relevant).</p> <p>Herved fremkommer den ændring af det bedste skøn, som kun vedrører ændringer af diskonteringsatser og relaterede finansielle antagelser.</p> |
| C0010–C0020/ R0110 | Andre ændringer, ikke forklaret andetsteds | Svarer til andre ændringer af det bedste skøn, som ikke opfanges i celle C0010/R0010-R0100 (livsforsikring) eller C0020/R0010-R0100 (skadesforsikring). |
| C0010–C0020/ R0120 | Bedste skøn ultimo — uden fradrag af genforsikring | Bedste skøn som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på forsikringsår (underwriting year approach — (UWY)). Summen af disse celler kan være nul (hvis der ikke er anvendt en metode baseret på forsikringsår) eller svare til det bedste skøn som opført i ultimobalancen, hvis der ikke er anvendt en metode baseret på ulykkesår. |
| | <i>Specifikation af ændring af bedste skøn — eventuelt analyse pr. forsikringsår — beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler</i> | |
| C0030–C0040/ R0130 | Bedste skøn primo | Bedste skøn over beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på forsikringsår (underwriting year approach — (UWY)). |
| C0030–C0040/ R0140 | Bedste skøn ultimo | Bedste skøn over beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, som opført i ultimobalancen for år N vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på forsikringsår (underwriting year approach — (UWY)). |
| | <i>Specifikation af ændring af bedste skøn — eventuelt analyse pr. ulykkesår — uden fradrag af genforsikring</i> | |
| C0050–C0060/ R0150 | Bedste skøn primo | Bedste skøn — med fradrag af genforsikring — som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på ulykkesår (accident year approach — AY). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0050–C0060/ R0160 | Usædvanlige elementer, som udløser tilpasning af bedste skøn primo | Det samme som for C0010 og C0020/R0020. |
| C0050–C0060/ R0170 | Afgrænsningsændringer | Det samme som for C0010 og C0020/R0030. |
| C0050–C0060/ R0180 | Valutaændring | Det samme som for C0010 og C0020/R0040. |
| C0050–C0060/ R0190 | Ændring af bedste skøn for risici, der dækkes i løbet af perioden | <p>Disse celler forventes hovedsageligt at være relevante for skadesforsikring og vedrører ændringer i (en del af) præmiehensættelserne (dvs. i forhold til alle anerkendte forpligtelser inden for aftalens rammer på værdiansættelsesdatoen, hvis kravet endnu ikke er fremsat) som følger:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Angiv den del af præmiehensættelserne ultimo år (N), der vedrører en dækningsperiode, som starter efter afslutningen ultimo år N. — Angiv den del af præmiehensættelserne ultimo år (N-1), der vedrører en dækningsperiode, som starter efter afslutningen ultimo år N. <p>Ændringen udledes af de to tal.</p> |
| C0050–C0060/ R0200 | Ændring af bedste skøn for risici, der dækkes i løbet af perioden | <p>Disse celler forventes hovedsageligt at være relevante for skadesforsikring og vedrører følgende:</p> <p>a) de præmiehensættelser ultimo år N-1 (eller den del heraf), som blev ændret til erstatningshensættelser ultimo år N som følge af krav fremsat i løbet af perioden.</p> <p>b) erstatningshensættelser, der vedrører krav fremsat i løbet af perioden (for hvilke, der ikke fandtes præmiehensættelser ultimo år N-1).</p> <p>Beregningen kan foretages som følger:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Angiv den del af erstatningshensættelserne ultimo år (N), der vedrører risici dækket i løbet af perioden. — Angiv den del af erstatningshensættelserne ultimo år (N-1), der vedrører risici dækket i løbet af perioden. <p>Ændringen udledes af de to tal.</p> |
| C0050–C0060/ R0210 | Ændring af bedste skøn, som skyldes afvikling af diskonteringsats — risici dækket forud for perioden | <p>Begrebet afvikling kan illustreres som følger: Det bedste skøn for år N-1 beregnes igen, men denne gang ved brug af den ændrede rentekurve.</p> <p>Ændringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Først beregnes den del af det bedste skøn primo, som vedrører risici dækket forud for perioden, dvs. bedste skøn primo med fradrag af præmiehensættelser, men inklusive eventuelle justeringer primo (jf. celle C0050/R0160-R0180 og C0060/R0160-R0180). — Dernæst beregnes afviklingen af diskonteringsatsen i løbet af år N, på grundlag af dette tal. |
| C0050–C0060/ R0220 | Ændring af bedste skøn, som skyldes forventede ind- og udgående strømme i år N — risici dækket forud for perioden | <p>Præmier, erstatninger og genkøb, som i det bedste skøn primo (vedrørende risici dækket forud for perioden) forventes betalt i løbet af året, indgår ikke længere i det bedste skøn ultimo, da de normalt er betalt/modtaget i løbet af året.</p> <p>Der skal derfor foretages en udlningsjustering.</p> <p>Justeringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| | | <p>— Først beregnes den del af det bedste skøn primo, som vedrører risici dækket forud for perioden, dvs. bedste skøn primo med fradrag af præmiehensættelser med fradrag af præmiehensættelser.</p> <p>— Dernæst afgrænses de forventede cash flow (cash in minus cash out) i det bedste skøn primo for den betragtede periode.</p> <p>— De afgrænsede cash flow skal lægges til det bedste skøn primo (med henblik på udligning) — og angives i celle C0050 og C0060/R0220.</p> |
| C0050–C0060/ R0230 | Ændring af bedste skøn, som skyldes erfaring — risici omfattet forud for perioden | <p>Den ændring af det bedste skøn, som angives her, vedrører kun forventede cash flow ved periodens udgang i forhold til de cash flow, der var forventede ved periodens begyndelse for perioderne N + 1 og derefter.</p> <p>Der angives kun ændringer som følge af det realiserede cash flow i år N og er ikke knyttet til ændringer i antagelser.</p> |
| C0050–C0060/ R0240 | Ændring af bedste skøn, som skyldes ændringer af ikkeøkonomiske antagelser — risici dækket forud for perioden | <p>Der henvises hovedsagelig til ændringer af det bedste skøn, som ikke skyldes realiserede forsikringstekniske strømme og ændringer af antagelser, som er direkte knyttet til forsikringsrisici (dvs. optionsintensiteten), der kan betegnes som ikkeøkonomiske antagelser.</p> <p>Ændringen, som skyldes ændringer af antagelser, kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> <p>Først beregnes det bedste skøn primo (celle C0050-C0060/R0150) inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0050-C0060/R0160-R0180) og indvirkningen af afvikling for forventede cash flow i år N (C0050-C0060/R0210-R0230).</p> <p>På grundlag af dette tal foretages der dernæst beregninger med nye antagelser, der ikke er knyttet til diskonteringsatser — som fandt anvendelse ultimo år N (hvis det er relevant).</p> <p>Herved fremkommer den ændring af det bedste skøn, som kun vedrører ændringer af disse antagelser. Herved opfanges muligvis ikke den ændring, der skyldes ændring fra sag til sag af indtrufne, men endnu ikke anmeldte krav, som derfor ville skulle lægges til beløbet.</p> <p>Hvis disse ændringer i forbindelse med skadesforsikring ikke kan skelnes fra ændringer, som skyldes erfaring, indberettes det samlede beløb under C0060/R0230.</p> |
| C0050–C0060/ R0250 | Ændring af det bedste skøn, som skyldes ændringer i det økonomiske miljø — risici dækket forud for perioden | <p>Der henvises hovedsagelig til antagelser, som ikke er direkte relateret til forsikringsrisici, dvs. hovedsagelig indvirkningen af ændringerne i det økonomiske miljø på cash flow (der tages højde for fremtidige ledelseshandlinger, f.eks. reduktion i de fremtidige diskretionære ydelser) og ændringer af diskonteringsatser.</p> <p>Hvis ændringer i forbindelse med skadeserstatning (C0060/R0250), som skyldes inflation, ikke kan skelnes fra ændringer, som skyldes erfaring, indberettes det samlede beløb under C0060/R0230.</p> <p>Ændringen kan afgrænses præcist ved følgende beregning:</p> <p>— Først beregnes det bedste skøn primo inklusive justeringen af det bedste skøn primo (celle C0050/R0160-R0180) og indvirkningen af afvikling for forventede cash flow og erfaring i år N (henholdsvis C0050/R0210-R0230 og C0060/R0210-R0230, eller alternativt henholdsvis C0050/R0210-R0240 og C0060/R0210-R0240).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | | <p>— På grundlag af dette tal foretages der dernæst beregninger med nye diskonteringsratser, som fandt anvendelse i løbet af år N, sammen med relaterede finansielle antagelser (hvis det er relevant).</p> <p>Herved fremkommer den ændring af det bedste skøn, som kun vedrører ændringer af diskonteringsratser og relaterede finansielle antagelser.</p> |
| C0050–C0060/ R0260 | Andre ændringer, ikke forklaret andetsteds | Svarer til andre ændringer af det bedste skøn, som ikke opfanges i celle C0050/R0150-R0250 (livsforsikring) eller C0060/R0150-R0250 (skadesforsikring). |
| C0050–C0060/ R0270 | Bedste skøn ultimo | Bedste skøn som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på ulykkesår (accident year approach — (AY)). |
| | | |
| | <i>Specifikation af ændring af bedste skøn — eventuelt analyse pr. ulykkesår — beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler</i> | |
| C0070–C0080/ R0280 | Bedste skøn primo | Bedste skøn over beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, som opført i ultimobalancen for år N-1 vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på ulykkesår (accident year approach — (AY)). |
| C0070–C0080/ R0290 | Bedste skøn ultimo | Bedste skøn over beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, som opført i ultimobalancen for år N vedrørende de brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, for hvilke det bedste skøn beregnes ved en metode baseret på ulykkesår (accident year approach — (AY)). |
| | | |
| | <i>Justeringer af forsikringsmæssige hensættelser i tilknytning til unit-linked aftaler, med en teoretisk set udliggende indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver</i> | |
| C0090/R0300 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Værdien repræsenterer nettoændringen, i balancen, af de aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked fonde og forsikringsmæssige hensættelser —indeksregulerede og unit-linked (beregnet som det bedste skøn og en risikomargin eller beregnet under et). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| | <i>Forsikringsmæssige strømme med indvirkning på forsikringsmæssige hensættelser</i> | |
| C0100–C0110/ R0310 | Præmier tegnet i perioden | Præmier tegnet i henhold til Solvens II, for henholdsvis livs- og skadesforsikring. |
| C0100–C0110/ R0320 | Krav og ydelser i perioden — med fradrag af restværdi og subrogation | Krav og ydelser, med fradrag af restværdi og subrogation, for henholdsvis livs- og skadesforsikring. Hvis beløbene allerede er medtaget i det bedste skøn, indgår de ikke som en del af denne post. |
| C0100–C0110/ R0330 | Udgifter (herunder ikke investeringsudgifter) | Udgifter (herunder ikke investeringsudgifter — som indberettes under S.29.02) for henholdsvis livs- og skadesforsikring. Hvis beløbene allerede er medtaget i det bedste skøn, indgår de ikke som en del af denne post. |
| C0100–C0110/ R0340 | Samlede forsikringsmæssige strømme med indvirkning på forsikringsmæssige bruttohensættelser | Samlede forsikringsmæssige strømme med indvirkning på forsikringsmæssige bruttohensættelser. |
| C0100–C0110/ R0350 | Forsikringsmæssige strømme i tilknytning til genforsikring i perioden (modtagne tilbagekrævede beløb med fradrag af indbetalte præmier) | Samlede forsikringsmæssige strømme i tilknytning til genforsikring, der kan tilbagekræves i perioden, dvs. modtagne tilbagekrævede beløb, med fradrag af præmier, for henholdsvis livs- og skadesforsikring. |
| | <i>Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver — Der skyldes forsikringsmæssige hensættelser</i> | |
| C0120–C0130/ R0360 | Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes forvaltningen af forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige bruttohensættelser | Beregningen foretages som følger: — tag ændringen i betragtning (primo minus ultimo) for det bedste skøn, risikomargin og forsikringsmæssige hensættelser, beregnet under et og overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — hertil lægges de samlede forsikringsmæssige strømme, dvs.: indgående minus udgående strømme vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser (C0100/R0340 for livsforsikring og C0110/R0340 for skadesforsikring). |
| C0120–C0130/ R0370 | Ændring i overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes forvaltningen af forsikringsmæssige hensættelser — Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Beregningen foretages som følger: — først fastlægges ændringen af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — og hertil lægges de samlede forsikringsmæssige strømme, dvs.: indgående minus udgående strømme i tilknytning til genforsikring i perioden. Hvis beløbet har en positiv indvirkning på overskydende aktiver i forhold til passiver, skal det være et positivt beløb. |

S.29.04 — Detaljeret analyse efter periode — forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema skal udfyldes på grundlag af Solvens II-værdiansættelsen, dvs. at tegnede præmier er defineret som præmier, der skal indbetales til selskabet i løbet af perioden. Når denne definition anvendes, er det ensbetydende med, at tegnede præmier i et givet år er præmier, som reelt skal indbetales i det pågældende år, uanset dækningsperioden. Definitionen af tegnede præmier er i overensstemmelse med definitionen af »præmieindtægter«.

Selskaberne skal indberette oplysningerne på ulykkesår- eller forsikringsårsbasis i overensstemmelse med den nationale tilsynsmyndigheds krav. Hvis den nationale tilsynsmyndighed ikke har bestemt, hvilket der skal anvendes, kan selskaberne anvende ulykkes- eller forsikringsår, alt efter hvordan de forvalter hver branche, forudsat at de anvender det samme år konsekvent igennem årene.

I opdelingen efter brancher med henblik på analyse efter periode henviser brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, både til direkte forsikringsvirksomhed og til accepteret proportional genforsikring.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0010 | Brancher | Brancher, for hvilke der kræves en opdeling med henblik på analysen efter periode. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 – 1 og 13 Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 – 2 og 14 Indkomstsikring 3 – 3 og 15 Arbejdsskadeforsikring 4 – 4 og 16 Motoransvarsforsikring 5 – 5 og 17 Anden motorforsikring 6 – 6 og 18 Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 – 7 og 19 Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 – 8 og 20 Almindelig ansvarsforsikring 9 – 9 og 21 Kredit- og kautionforsikring 10 – 10 og 22 Retshjælpsforsikring 11 – 11 og 23 Assistance 12 – 12 og 24 Diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. 28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring. 37 — Livsforsikring (herunder branche 30, 31, 32, 34 og 36, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35 38 — SLT-sygeforsikring (herunder branche 29, 33 og 35) |
| | <i>Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsår</i> | |
| | <i>Risici accepteret i løbet af perioden</i> | |
| C0010/R0010 | Tegnede præmier tegnet i løbet af perioden | Den del af de tegnede præmier i perioden, som svarer til aftaler indgået i løbet af året. Der kan anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af de samlede tegnede præmier under Solvens II, der er knyttet til aftaler indgået i løbet af året. |
| C0010/R0020 | Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | Den del af kravene og ydelserne, med fradrag af restværdi og subrogation i perioden, som svarer til de risici, der accepteres i løbet af perioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | | Der kan anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af de samlede krav, forudsat at de til slut stemmer overens med de samlede krav og ydelser, med fradrag af tilbagebetalt restværdi og subrogation, som indberettet i C0100/R0320 fra S.29.03 og C0110/R0320 fra S.29.03. |
| C0010/R0030 | Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | Den del af udgifterne i perioden, som svarer til de risici, der accepteres i løbet af perioden. Der kan anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af de samlede udgifter, forudsat at de til slut stemmer overens med de samlede udgifter, som indberettet i C0100/R0330 fra skema S.29.03 og C0110/R0330 fra skema S.29.03. |
| C0010/R0040 | Ændring af bedste skøn | Svarer til ændringen af det bedste skøn for de risici, der accepteres i løbet af perioden. |
| C0010/R0050 | Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | Den del af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, der svarer til de risici, der accepteres i løbet af perioden. Der kan anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af den samlede ændring af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, forudsat at de til slut stemmer overens med den samlede ændring. |
| C0010/R0060 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Værdien repræsenterer nettoændringen, i balancen, af de aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked fonde og forsikringsmæssige hensættelser —indeksregulerede og unit-linked (beregnet som det bedste skøn og en risikomargin eller beregnet under et). |
| C0010/R0070 | I alt | Den samlede virkning af risici, der accepteres i løbet af perioden — uden fradrag af genforsikring. |
| | <i>Risici accepteret forud for perioden</i> | |
| C0020/R0010 | Tegnede præmier i henhold til aftaler indgået i løbet af perioden | Den del af de tegnede præmier i perioden, som svarer til aftaler indgået forud for perioden. Se vejledningen til C0010/R0010. |
| C0020/R0020 | Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | Den del af kravene og ydelserne, med fradrag af restværdi og subrogation i perioden, som svarer til de risici, der accepteres forud for perioden. Se vejledningen til C0010/R0020. |
| C0020/R0030 | Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | Den del af udgifterne i perioden, som svarer til de risici, der accepteres forud for perioden. Se vejledningen til C0010/R0030. |
| C0020/R0040 | Ændring af det bedste skøn | Ændring af det bedste skøn, som skyldes forventede ind- og udgående strømme i år N — risici accepteret forud for perioden (uden fradrag af genforsikring) Samtlige indberettede brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, skal svare til summen af celle C0010/R0060 til C0010/R0100 fra skema S.29.03 og celle C0020/R0060 til C0020/R0100 fra skema S.29.03. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0020/R0050 | Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | Den del af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, der svarer til de risici, der accepteres forud for perioden. Se vejledningen til C0010/R0050. |
| C0020/R0060 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Se vejledningen til C0010/R0060. |
| C0020/R0070 | I alt | De samlede ændringer i tilknytning til risici, der accepteres forud, uden fradrag af genforsikring. |
| | <p>Detaljeret analyse efter periode — Forsikringsmæssige strømme vs. forsikringsmæssige hensættelser — Ulykkesår</p> | |
| | <p>Risici, der dækkes efter perioden</p> | |
| C0030/R0080 | Tegnede præmier | Svarer til den del af de tegnede præmier, som vedrører risici, der dækkes efter perioden, dvs. præmier, som skal tjenes efter perioden. Der kan endvidere anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af præmierne, som knyttes til risici, der dækkes efter perioden. |
| C0030/R0090 | Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | Svarer til den del af kravene og ydelserne, med fradrag af restværdi og subrogation, der vedrører risici, der dækkes efter perioden (teoretisk set nul). Se vejledningen til C0010/R0020. |
| C0030/R0100 | Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | Den del af udgifterne i perioden, som svarer til de risici, der dækkes efter perioden. Se vejledningen til C0010/R0030. |
| C0030/R0110 | Ændring af bedste skøn | Denne ændring af det bedste skøn skal svare til summen af celle C0050/R0190 fra skema S.29.03 og celle C0060/R0190 fra skema S.29.03, hvis analysen i S.29.03 udføres på grundlag af brancher. Beløbet vedrører ændringer i (en del af) præmiehensættelserne (dvs. i forhold til alle anerkendte forpligtelser inden for aftalens rammer på værdiansættelsesdatoen, hvis kravet endnu ikke er fremsat) som følger: — Angiv den del af præmiehensættelserne ultimo år (N), der vedrører en dækningsperiode, som starter efter afslutningen ultimo år N. — Angiv den del af præmiehensættelserne ultimo år (N-1), der vedrører en dækningsperiode, som starter efter afslutningen ultimo år N (dvs. i tilfælde af præmiehensættelser i tilknytning til forpligtelser vedrørende mere end en enkelt fremtidig indberetningsperiode). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | | I det tilfælde, at præmiehensættelserne ultimo år (N-1) omfatter beløb, som der blev fremsat krav om i løbet af år N, tages dette beløb ikke i betragtning i ændringen af det bedste skøn af risici, der dækkes efter perioden, men i stedet i ændringen af det bedste skøn af risici, der dækkes i løbet af perioden, da denne hensættelse er blevet ændret til en erstatningshensættelse. |
| C0030/R0120 | Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | Den del af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, der svarer til de risici, der dækkes efter perioden. Se vejledningen til C0010/R0050. |
| C0030/R0130 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Denne celle anses ikke for at være relevant for skadesforsikring. Se vejledningen til C0010/R0060. |
| C0030/R0140 | I alt | De samlede ændringer i tilknytning til risici, der dækkes efter perioden, uden fradrag af genforsikring. |
| | <i>Risici, der dækkes i løbet af perioden</i> | |
| C0040/R0080 | Tegnede præmier | Svarer til den del af de tegnede præmier, som vedrører risici, der dækkes i løbet af perioden, dvs. præmieindtægter under Solvens II. Der kan endvidere anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af præmierne, som knyttes til risici, der dækkes efter perioden. |
| C0040/R0090 | Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | Svarer til den del af kravene og ydelserne, med fradrag af restværdi og subrogation, der vedrører risici, der dækkes i løbet af perioden. Se vejledningen til C0010/R0020. |
| C0040/R0100 | Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | Den del af udgifterne i perioden, som svarer til de risici, der dækkes i løbet af perioden. Se vejledningen til C0010/R0030. |
| C0040/R0110 | Ændring af bedste skøn | Beløbet for ændringen af det bedste skøn for de risici, der dækkes i løbet af perioden. For risici, der dækkes i løbet af perioden: Denne ændring af det bedste skøn skal svare til summen af celle C0050/R0200 fra skema S.29.03 og celle C0060/R0200 fra skema S.29.03, hvis analysen i S.29.03 udføres på grundlag af brancher. Den beløbsmæssige størrelse henviser til følgende tilfælde: a) Præmiehensættelser ultimo år N-1, som blev ændret til erstatningshensættelser ultimo år N som følge af krav fremsat i løbet af perioden. b) Erstatningshensættelser, der vedrører krav fremsat i løbet af perioden (for hvilke, der ikke fandtes præmiehensættelser ultimo år N-1). |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| | | <p>Beregningen kan foretages som følger:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Angiv den del af erstatningshensættelserne ultimo år (N), der vedrører risici dækket i løbet af perioden. — Angiv den del af erstatningshensættelserne ultimo år (N-1), der vedrører risici dækket i løbet af perioden. <p>Ændringen udledes af de to tal.</p> |
| C0040/R0120 | Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | <p>Den del af de forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et, der svarer til de risici, der dækkes i løbet af perioden.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0050.</p> |
| C0040/R0130 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | <p>Denne celle anses ikke for at være relevant for skadesforsikring.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0060.</p> |
| C0040/R0140 | I alt | <p>De samlede ændringer i tilknytning til risici, der dækkes i løbet af perioden, uden fradrag af genforsikring.</p> |
| <i>Risici, der accepteres forud for perioden</i> | | |
| C0050/R0080 | Tegnede præmier | <p>Svarer til den del af de tegnede præmier, som vedrører risici, der dækkes forud for perioden, dvs. præmieindtægter under Solvens II (når præmien først forfalder efter dækningsperioden).</p> <p>Der kan endvidere anvendes fordelingsnøgler til at identificere denne del af præmierne.</p> |
| C0050/R0090 | Krav og ydelser — Med fradrag af beløb fra restværdi og subrogation | <p>Svarer til den del af kravene og ydelserne, med fradrag af restværdi og subrogation, der vedrører risici, der dækkes forud for perioden.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0020.</p> |
| C0050/R0100 | Udgifter (knyttet til forsikrings- og genforsikringsforpligtelser) | <p>Den del af udgifterne i perioden, som svarer til de risici, der dækkes forud for perioden.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0030.</p> |
| C0050/R0110 | Ændring af bedste skøn | <p>Svarer for risici, der dækkes forud for perioden, til forventede ind- og udgående strømme i år N for risici, der accepteres forud for perioden. For risici, der er dækket forud for denne periode, skal denne ændring af det bedste skøn svare til summen af celle R0210/C0050-C0060 til R0250/C0050-C0060 fra skema S.29.03, hvis analysen i S.29.03 udføres på grundlag af brancher.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| | | <p>Beregningen kan foretages som følger:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Først beregnes den del af det bedste skøn primo, som vedrører risici dækket forud for perioden, dvs. bedste skøn primo med fradrag af præmiehensættelser med fradrag af præmiehensættelser. — Dernæst afgrænses de forventede cash flow (cash in minus cash out) i det bedste skøn primo for den betragtede periode. — De afgrænsede cash flow skal lægges til det bedste skøn primo (med henblik på udligning). |
| C0050/R0120 | Ændring af forsikringsmæssige hensættelser under et | <p>Den del af de forsikringsmæssige hensættelser under et, der svarer til de risici, der dækkes forud for perioden.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0050.</p> |
| C0050/R0130 | Nettoændring i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | <p>Denne celle anses ikke for at være relevant for skadesforsikring.</p> <p>Se vejledningen til C0010/R0060.</p> |
| C0050/R0140 | I alt | <p>De samlede ændringer i tilknytning til risici, der dækkes forud for perioden, uden fradrag af genforsikring.</p> |

S.30.01 — Grundlæggende oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for forsikrings- og genforsikringsselskaber, som anvender fakultativ genforsikring og/eller retrocession af virksomhed.

Det udfyldes af skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsselskaber og af livsforsikrings- og livsgenforsikringsselskaber med oplysninger om fakultative dækninger i næste indberetningsår, herunder oplysninger om de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringsselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største. De enkelte fakultative risici forelægges for genforsikringsselskabet, og vilkårene og betingelserne for den fakultative genforsikring forhandles individuelt i forbindelse med de enkelte policer. Traktater, som automatisk dækker risici, er ikke omfattet af dette skema og skal indberettes i S.30.03.

Hver forsikringsrisiko tildeles en unik kode fastlagt ved »risikoidentifikationskoden«.

Dette skema er prospektivt (skal være i overensstemmelse med S.30.03) og skal som sådan afspejle de genforsikringsaftaler, der gælder og er gyldige i næste indberetningsår for de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største. Selskaber skal indberette de vigtigste risici for næste indberetningsperiode, som er omfattet af genforsikringsaftaler, der er gyldige i næste indberetningsperiode. Hvis genforsikringsstrategien ændres væsentligt efter gyldighedsdatoen, eller hvis genforsikringsaftalerne fornyes efter indberetningsdatoen og før den 1. januar i det efterfølgende år, skal oplysningerne i dette skema, hvis det er relevant, indgives på ny.

Fakultative placeringer, som omfatter forskellige brancher, skal også indgå i diverse relevante brancher, hvis de er blandt de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største risici i samme branche.

Dette skema bør kun indberettes, hvis de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det bedste skøn beregnet separat for livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed.

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| <i>Fakultative dækninger for skader</i> | | |
| C0020 | Kode for genforsikringsprogram | Selskabsspecifik genforsikringskode, som er knyttet til den væsentligste aftale i genforsikringsprogrammet, der også dækker den risiko, som dækkes ved den fakultative genforsikring. Genforsikringsprogramkoden skal stemme overens med genforsikringsprogramkoden i S.30.03 — Det cederende genforsikringsprogram i næste indberetningsår. |
| C0030 | Risikoidentifikationskode | For hver skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udvælges de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringsselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største, der er omfattet af fakultativ genforsikring, som er gældende i den efterfølgende indberetningsperiode (også hvis de stammer fra de foregående år). Koden er et unikt identifikationsnummer tildelt af forsikringsselskabet, som identificerer den pågældende risiko, og som skal forblive uændret i de efterfølgende årlige indberetninger. Når denne kode er tildelt, anvendes den ikke til en anden risiko, heller ikke hvis den risiko, hvortil koden oprindeligt var tildelt, ikke længere eksisterer. Når en risiko berører mere end én branche, anvendes den samme kode for alle de berørte brancher. |
| C0040 | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Hver fakultativ genforsikringsplacering skal tildeles et løbenummer, som er unikt for den pågældende risiko. Identifikationskoden for den fakultative genforsikringsplacering er enhedsspecifik. |
| C0041 | Branche vedrørende skadesforsikring | Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring</p> <p>15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring</p> <p>16 — Proportional motoransvarsgenforsikring</p> <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> |
| C0042 | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | <p>Angiv venligst, om eksponeringen er blandt selskabets 20 største eksponeringer</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Tilhører de 20 største</p> <p>2 — Branchen tilhører ikke de 20 største</p> |
| C0050 | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | <p>Identifikation af genforsikringsaftalen. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Utraditionel eller finite reinsurance</p> <p>(i tilfælde af en genforsikringsaftale eller et finansielt instrument, som ikke er direkte baseret på princippet om erstatning, eller som er baseret på en aftale, der er udfærdiget således, at den kun har en begrænset eller ingen påviselig mekanisme til risikooverførsel)</p> <p>2 — Andre end utraditionel eller finite reinsurance</p> <p>I tilfælde af finite reinsurance eller et lignende arrangement skal kun de poster udfyldes, som kan udfyldes.</p> |
| C0060 | Proportional | <p>Angiv, om genforsikringsprogrammet er en proportional genforsikring, dvs. om det omfatter et genforsikringsselskab, som tager en bestemt procentvis andel af hver police, som et forsikringsselskab tegner. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Proportional genforsikring</p> <p>2 — Ikkeproportional genforsikring</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0070 | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | Hvis risikoen vedrører et selskab, angives navnet på det selskab, som risikoen vedrører. Hvis risikoen vedrører en fysisk person, pseudonymiseres det oprindelige police-nummer, og der indberettes pseudonymiserede oplysninger. Ved pseudonymiserede data forstås data, som ikke kan knyttes til en bestemt person uden brug af yderligere oplysninger, og sådanne yderligere oplysninger opbevares særskilt. Der skal sikres konsistens over tid. Det er ensbetydende med, at enkeltstående forsikringsrisici, som optræder fra år til år, skal have det samme pseudonymiserede format. |
| C0080 | Risikobeskrivelse | Beskrivelse af risikoen. Afhængigt af branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, indberettes det, hvilken type selskab, bygning eller beskæftigelse den specifikke forsikringsrisiko er knyttet til. |
| C0090 | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | Beskrivelse af den fakultative risikodæknings væsentligste anvendelsesområde. Den indgår normalt som en del af den beskrivelse, der anvendes til at identificere placeringen. Beskrivelsen af den dækkede risikokategori er enhedsspecifik og ikke obligatorisk. Endvidere er udtrykket »risikokategori« ikke baseret på den terminologi, der anvendes i direktiv 2009/138/EF eller delegeret forordning (EU) 2015/35/EF, men kan betragtes som endnu en mulighed for at give yderligere oplysninger om den eller de givne forsikringsrisici. |
| C0100 | Gyldighedsperiode (startdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning blev påbegyndt, dvs. den dato, hvor dækningen trådte i kraft. |
| C0110 | Gyldighedsperiode (slutdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning udløb. Hvis betingelserne for dækning forbliver uændrede, når skemaet udfyldes, og selskabet ikke gør brug af opsigelsesklausulen, er udløbsdatoen den næste mulige udløbsdato. |
| C0120 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved placering af den fakultative dækning. Samtlige beløb skal opgives i denne valuta for den særlige fakultative dækning, medmindre den nationale tilsynsmyndighed kræver andet. Hvis den fakultative dækning placeres i to forskellige valutaer, angives den vigtigste valuta. |
| C0130 | Forsikringssum | Det største beløb, som forsikringsselskabet kan blive forpligtet til at udbetale i henhold til policen. Forsikringssummen er knyttet til forsikringsrisikoen. Hvis den fakultative dækning omfatter en række eksponeringer/risici i hele landet, præciseres rammerne for den samlede police. Hvis risikoen er accepteret på grundlag af coassurance, svarer forsikringssummen til det indberettende skadesforsikringsselskabs maksimale forpligtelse. I tilfælde af en ubegrænset forsikringssum, angives der i »Forsikringssum« et skøn over det forventede mulige tab (beregnet ved anvendelse af samme metoder som for beregningen af præmien, hvilket afspejler den faktiske risikoeksponering), |
| C0140 | Type forsikringsmodel | Den type forsikringsmodel, som anvendes til at danne sig et skøn over eksponeringen i forbindelse med forsikringsrisikoens og over behovet for genforsikringsdækning. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forsikringssum Det største beløb, som forsikringsselskabet kan blive forpligtet til at udbetale i henhold til den oprindelige police. Forsikringssummen skal også angives, hvis type forsikringsmodel ikke er relevant. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>2 — Størst mulige tab</p> <p>Det tab, som kan opstå ved en mere eller mindre tilfældig kombination af de mest uheldige omstændigheder; branden standses kun på grund af ikke passerbare genstande eller manglende materiale.</p> <p>3 — Størst sandsynlige tab</p> <p>Det er defineret som et skøn over det største tab på grund af en enkeltstående brand eller risiko, der kan forventes, idet det antages, at den mest uheldige enkeltstående hindring for primære private brandsikringssystemer gør sig gældende, men at sekundære sikringssystemer eller -organer (f.eks. en indsats fra beredskabsorganer og et privat og/eller offentligt brandkorps) fungerer som forventet. Katastrofesituationer, f.eks. eksplosioner på grund af et massivt udslip af brandfarlige gasser, som kunne omfatte store områder af driftsanlægget, detonation af massive sprængstoffer, seismiske forstyrrelser, flodbølger eller oversvømmelser, flystyrt og brandstiftelse på mere end et enkelt område indgår ikke i dette skøn. Denne definition er en kombination af det største mulige og det største skønnede tab, som normalt accepteres og ofte anvendes af forsikringsselskaber, genforsikringsselskaber og reassurancemæglere.</p> <p>4 — Størst skønnede tab</p> <p>Det tab, som med rimelighed kan forventes at blive påført som følge af de uforudsete forhold, der tages i betragtning, på grund af en enkeltstående hændelse, der anses for at være en mulighed under hensyntagen til de faktorer, der sandsynligvis vil forøge eller reducere tabets omfang, herunder dog ikke sådanne tilfældigheder og katastrofer, som kan være mulige, men som forbliver usandsynlige.</p> <p>5 — Andet</p> <p>andre forsikringsmodeller, der kan anvendes. Det skal i den regelmæssige tilsynsrapport forklares, hvilke »andre« typer forsikringsmodeller der anvendes.</p> <p>Selv om ovennævnte definitioner anvendes i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, »Forsikring mod brand og andre skader på ejendom«, kunne lignende definitioner eventuelt anvendes i forbindelse med andre brancher.</p> |
| C0150 | Beløb i henhold til forsikringsmodel | Det største tab som følge af forsikringsrisikoen i henhold til den anvendte forsikringsmodel. |
| C0160 | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring med alle genforsikringsselskaber | Det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring, er den del af forsikringssummen, som er dækket ved fakultativ genforsikring. Beløbet skal stemme overens med forsikringssummen i C0130 og afspejler de fakultative genforsikringsselskabers maksimale forpligtelse (100 %). |
| C0170 | Fakultativ genforsikringspræmie cederet til alle genforsikringsselskaber for 100 % af genforsikringsplaceringen | Forventet årlig eller tegnet genforsikringsbruttopræmie, uden fradrag af cederingsprovision, cederet til genforsikringsselskaber for deres andel. |

Fakultative dækninger for livsforsikring

| | | |
|-------|--------------------------------|--|
| C0190 | Kode for genforsikringsprogram | Selskabsspecifik genforsikringskode, som er knyttet til den væsentligste aftale i genforsikringsprogrammet, der også dækker den risiko, som dækkes ved den fakultative genforsikring. Genforsikringsprogramkoden skal stemme overens med genforsikringsprogramkoden i S.30.03 — Det cederende genforsikringsprogram i næste indberetningsår. |
|-------|--------------------------------|--|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0200 | Risikoidentifikationskode | <p>For hver livsforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udvælges de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største med hensyn til eksponering, der er omfattet af fakultativ genforsikring, som er gældende i indberetningsperioden (også hvis de stammer fra de foregående år). Koden er et unikt identifikationsnummer tildelt af forsikringselskabet, som identificerer den pågældende risiko inden for branchen, og denne kode kan ikke genanvendes til andre risici i den samme branche og skal forblive uændret i de efterfølgende årlige indberetninger.</p> <p>Når denne kode er tildelt, anvendes den ikke til en anden risiko, heller ikke hvis den risiko, hvortil koden oprindeligt var tildelt, ikke længere eksisterer.</p> <p>Når en risiko berører mere end én branche, anvendes den samme kode for alle de berørte brancher.</p> |
| C0210 | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Hver fakultativ genforsikringsplacering skal tildeles et løbenummer, som er unikt for den pågældende risiko. Identifikationskoden for den fakultative genforsikringsplacering er enhedsspecifik. |
| C0211 | Branche vedrørende livsforsikring | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>29 — Sygeforsikring</p> <p>30 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> <p>32 — Anden livsforsikring</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livsgenforsikring.</p> |
| C0212 | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | <p>Angiv venligst, om eksponeringen er blandt selskabets 20 største eksponeringer</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Tilhører de 20 største</p> <p>2 — Branchen tilhører ikke de 20 største</p> |
| C0220 | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Utraditionel eller finite reinsurance</p> <p>(i tilfælde af en genforsikringsaftale eller et finansielt instrument, som ikke er direkte baseret på princippet om erstatning, eller som er baseret på en aftale, der er udfærdiget således, at den kun har en begrænset eller ingen påviselig mekanisme til risikooverførsel)</p> <p>2 — Andre end utraditionel eller finite reinsurance</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0230 | Proportional | <p>Angiv, om genforsikringsprogrammet er en proportional genforsikring, dvs. om det omfatter et genforsikringsselskab, som tager en bestemt procentvis andel af hver police, som et forsikringsselskab tegner. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Proportional genforsikring</p> <p>2 — Ikkeproportional genforsikring</p> |
| C0240 | Identifikation af det selskab eller den person, som risikoen vedrører | <p>Hvis risikoen vedrører et selskab, angives navnet på det selskab, som risikoen vedrører.</p> <p>Hvis risikoen vedrører en fysisk person, pseudonymiseres det oprindelige police-nummer, og der indberettes pseudonymiserede oplysninger. Ved pseudonymiserede data forstås data, som ikke kan knyttes til en bestemt person uden brug af yderligere oplysninger, og sådanne yderligere oplysninger opbevares særskilt. Der skal sikres konsistens over tid. Det er ensbetydende med, at enkeltstående forsikringsrisici, som optræder fra år til år, skal have det samme pseudonymiserede format.</p> |
| C0250 | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | <p>Beskrivelse af den fakultative risikodæknings væsentligste anvendelsesområde. Den indgår normalt som en del af den beskrivelse, der anvendes til at identificere placeringen.</p> <p>Beskrivelsen af den dækkede risikokategori er enhedsspecifik og ikke obligatorisk. Endvidere er udtrykket »risikokategori« ikke baseret på den terminologi, der anvendes i Solvens II-direktivet, og kan betragtes som endnu en mulighed for at give yderligere oplysninger om den eller de givne forsikringsrisici.</p> |
| C0260 | Gyldighedsperiode (startdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning blev påbegyndt, dvs. den dato, hvor dækningen trådte i kraft. |
| C0270 | Gyldighedsperiode (slutdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige dækning udløb. |
| C0280 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved placering af den fakultative dækning. Samtlige beløb under denne post skal opgives i denne valuta for den særlige fakultative dækning, medmindre den nationale tilsynsmyndighed kræver andet. Hvis den fakultative dækning placeres i to forskellige valutaer, angives den vigtigste valuta. |
| C0290 | Forsikringssum | Det beløb, som livsforsikringsselskabet udbetaler til den begunstigede. Hvis risikoen er dækket ved co-assurance med andre livsforsikringsselskaber, indberettes den forsikringssum, som det indberettende livsforsikringsselskab skal betale, her. |
| C0300 | Risikosum | <p>Risikosum som defineret i delegeret forordning (EU) 2015/35/EF.</p> <p>Hvis risikoen er dækket ved co-assurance med andre livsforsikringsselskaber, indberettes den risikosum, der vedrører livsforsikringsselskabets beløbsmæssige andel i forsikringssummen, her.</p> |
| C0310 | Beløb dækket ved fakultativ genforsikring med alle genforsikringsselskaber | Det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring, er den del af forsikringssummen, som er dækket ved fakultativ genforsikring. Beløbet skal stemme overens med forsikringssummen i C0290 og afspejler de fakultative genforsikringsselskabers maksimale forpligtelse (100 %). |
| C0320 | Fakultativ genforsikringspræmie cederet til alle genforsikringsselskaber for 100 % af genforsikringsplaceringen | Forventet årlig eller tegnet genforsikringsbruttopræmie, uden fradrag af cederingsprovision, cederet til genforsikringsselskaber for deres andel. |

S.30.02 — Oplysninger om fakultative dækninger for skadesforsikrings- og livsforsikringsvirksomhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for forsikrings- og genforsikringsselskaber, som anvender fakultativ genforsikring og/eller retrocession af virksomhed.

Det udfyldes af skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsselskaber og af livsforsikrings- og livs-genforsikringsselskaber med oplysninger om genforsikringsandelen af fakultative dækninger i næste indberetningsår, herunder oplysninger om de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringsselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største, (f.eks. i tilfælde, hvor de accepterede risici ikke stemmer overens med den almindelige politik for accept af risici og kun kunne accepteres, hvis en del af risikoen dækkes ved fakultativ genforsikring). De enkelte fakultative risici forelægges for genforsikringsselskabet, og vilkårene og betingelserne for den fakultative genforsikring forhandles individuelt i forbindelse med de enkelte policer. Traktater, som automatisk dækker risici, er ikke omfattet af dette skema og skal indberettes i S.30.03.

Endvidere tildeles hver forsikringsrisiko en unik kode fastlagt ved »risikoidentifikationskoden«. De udvalgte risici adskilles for at få de unikke betingelser for en aftale på en enkelt række. Hvis en fakultativ dækning som indberettet i skema S.30.01 vedrører mere end et genforsikringsselskab, udfyldes dette skema med så mange rækker som antallet af genforsikringsselskaber, der er involveret i den specifikke fakultative dækning.

Dette skema er prospektivt (skal være i overensstemmelse med S.30.03) og skal som sådan afspejle de genforsikringsaftaler, der er effektive og gyldige i næste indberetningsår, for de udvalgte 20 største fakultative genforsikringseksponeringer generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største. Selskaber skal indberette de vigtigste risici for næste indberetningsperiode, som er omfattet af genforsikringsaftaler, der er gyldige i næste indberetningsperiode. Hvis genforsikringsstrategien ændres væsentligt efter gyldighedsdatoen, eller hvis genforsikringsaftalerne fornyes efter indberetningsdatoen og før den 1. januar i det efterfølgende år, skal oplysningerne i dette skema, hvis det er relevant, indgives på ny.

Fakultative placeringer, som omfatter forskellige brancher, skal også indgå i de forskellige rækker, hvis de er blandt de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største risici i samme branche.

Dette skema udfyldes for hvert genforsikringsselskab, som har accepteret den fakultative dækning.

Dette skema bør kun indberettes, hvis de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det bedste skøn beregnet separat for livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Fakultative dækninger for skader

| | | |
|-------|--------------------------------|---|
| C0020 | Kode for genforsikringsprogram | Selskabsspecifik genforsikringskode, som er knyttet til den væsentligste aftale i genforsikringsprogrammet, der også dækker den risiko, som dækkes ved den fakultative genforsikring. Genforsikringsprogramkoden skal stemme overens med genforsikringsprogramkoden i S.30.03 — Det cederende genforsikringsprogram i næste indberetningsår. |
| C0030 | Risikoidentifikationskode | For hver skadesforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udvælges de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringsselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største med hensyn til eksponering, der er omfattet af fakultativ genforsikring, som er gældende i indberetningsperioden (også hvis de stammer fra de foregående år). Koden er et unikt identifikationsnummer tildelt af forsikringsselskabet, som identificerer den pågældende risiko, og som skal forblive uændret i de efterfølgende årlige indberetninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>Når denne kode er tildelt, anvendes den ikke til en anden risiko, heller ikke hvis den risiko, hvortil koden oprindeligt var tildelt, ikke længere eksisterer.</p> <p>Når en risiko berører mere end én branche, anvendes den samme kode for alle de berørte brancher.</p> |
| C0040 | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Hver fakultativ genforsikringsplacering skal tildeles et løbenummer, som er unikt for den pågældende risiko. Identifikationskoden for den fakultative genforsikringsplacering er enhedsspecifik. |
| C0050 | Kode for genforsikringselskabet | <p>Identifikationskode for genforsikringselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. <p>En specifik kode tildelt af selskabet skal være unik for den specifikke mægler og må ikke overlappe i forhold til andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden.</p> <p>Hvis der allerede findes en kode (f.eks. en national identifikator), anvendes den samme kode som identifikator konsistent over tid, indtil der findes en LEI-kode</p> |
| C0051 | Genforsikringselskabets kodetype | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0061 | Branche vedrørende skadesforsikring | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpssgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring.</p> |
| C0065 | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | <p>Angiv venligst, om eksponeringen er blandt selskabets 20 største eksponeringer</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Tilhører de 20 største</p> <p>2 — Branchen tilhører ikke de 20 største</p> |
| C0100 | Genforsikringselskabets andel (%) | <p>Den procentdel af den fakultative placering, som genforsikringselskabet accepterer, udtrykt som en absolut procentdel af det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring, med alle genforsikringselskaber, som indberettet under C0160 i S.30.01 — Fakultative dækninger (med hensyn til genforsikret eksponering) — Grundlæggende oplysninger.</p> <p>Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal.</p> |
| C0110 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved placering af den fakultative dækning. Samtlige beløb skal opgives i denne valuta for den særlige fakultative dækning, medmindre den nationale tilsynsmyndighed kræver andet. Hvis den fakultative dækning placeres i to forskellige valutaer, angives den vigtigste valuta.</p> |
| C0120 | Genforsikringssum til det fakultative genforsikringselskab | <p>Det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring med genforsikringselskabet.</p> |
| C0130 | Fakultativ cederet genforsikringspræmie | <p>Forventet årlig eller tegnet genforsikringsbruttopræmie cederet til genforsikringselskabet for deres andel.</p> |
| C0140 | Kommentarer | <p>Beskriv tilfælde, enten hvor genforsikringselskabets andel er underlagt andre betingelser end dem, der gælder for almindelige fakultative placeringer eller placeringer i henhold til aftale, eller for at tilvejebringe andre oplysninger, som selskabet eventuelt skal indberette til tilsynsmyndigheden.</p> |

Fakultative dækninger for livsforsikring

| | | |
|-------|--------------------------------|---|
| C0150 | Kode for genforsikringsprogram | <p>Selskabsspecifik genforsikringskode, som er knyttet til den væsentligste aftale i genforsikringsprogrammet, der også dækker den risiko, som dækkes ved den fakultative genforsikring. Genforsikringsprogramkoden skal stemme overens med genforsikringsprogramkoden i S.30.03 — Det cederende genforsikringsprogram i næste indberetningsår.</p> |
|-------|--------------------------------|---|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0160 | Risikoidentifikationskode | <p>For hver livsforsikringsbranche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, udvælges de 20 største fakultative genforsikringseksponeringer (en del af forsikringssummen overføres til alle genforsikringselskaber) generelt set plus de to største i hver branche, hvis disse ikke er omfattet af de 20 største med hensyn til eksponering, der er omfattet af fakultativ genforsikring, som er gældende i indberetningsperioden (også hvis de stammer fra de foregående år). Koden er et unikt identifikationsnummer tildelt af forsikringselskabet, som identificerer den pågældende risiko inden for branchen, og denne kode kan ikke genanvendes til andre risici i den samme branche og skal forblive uændret i de efterfølgende årlige indberetninger.</p> <p>Når denne kode er tildelt, anvendes den ikke til en anden risiko, heller ikke hvis den risiko, hvortil koden oprindeligt var tildelt, ikke længere eksisterer.</p> <p>Når en risiko berører mere end én branche, anvendes den samme kode for alle de berørte brancher.</p> |
| C0170 | Identifikationskode for fakultativ genforsikringsplacering | Et løbenummer, som er unikt for den pågældende risiko, og som tildeles til hver enkelt fakultativ genforsikringsplacering. |
| C0180 | Genforsikringselskabets kode | <p>Identifikationskode for genforsikringselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. <p>En specifik kode tildelt af selskabet skal være unik for det specifikke genforsikringselskab og må ikke overlappe andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden.</p> <p>Hvis der allerede findes en kode (f.eks. en national identifikator), anvendes den samme kode som identifikator konsistent over tid, indtil der findes en LEI-kode</p> |
| C0181 | Genforsikringselskabets kodelystype | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0191 | Branche vedrørende livsforsikring | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 29 — Sygeforsikring 30 — Forsikring med gevinstandele 31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring 32 — Anden livsforsikring 33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser 34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser 35 — Sygegenforsikring 36 — Livs-genforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0195 | Angivelse af tilhørsforhold til de 20 største eksponeringer | Angiv venligst, om eksponeringen er blandt selskabets 20 største eksponeringer Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Tilhører de 20 største 2 — Branchen tilhører ikke de 20 største |
| C0230 | Genforsikringsselskabets andel (%) | Den procentdel af den fakultative placering, som genforsikringsselskabet accepterer, udtrykt som en absolut procentdel af det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring, med alle genforsikringsselskaber, som indberettet under C0310 i S.30.01 — Fakultative dækninger (med hensyn til genforsikret eksponering) — Grundlæggende oplysninger. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. |
| C0240 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved placering af den fakultative dækning. Samtlige beløb skal opgives i denne valuta for den særlige fakultative dækning, medmindre den nationale tilsynsmyndighed kræver andet. Hvis den fakultative dækning placeres i to forskellige valutaer, angives den vigtigste valuta. |
| C0250 | Genforsikringssum til det fakultative genforsikringsselskab | Det beløb, der er dækket ved fakultativ genforsikring med genforsikringsselskabet. |
| C0260 | Fakultativ cederet genforsikringspræmie | Forventet årlig eller tegnet genforsikringsbruttopræmie cederet til genforsikringsselskabet for deres andel. |
| C0270 | Kommentarer | Beskriv tilfælde, enten hvor genforsikringsselskabets andel er underlagt andre betingelser end dem, der gælder for almindelige fakultative placeringer eller placeringer i henhold til aftale, eller for at tilvejebringe andre oplysninger, som selskabet eventuelt skal indberette til tilsynsmyndigheden. |

Oplysninger om genforsikringsselskaber og mæglere

| | | |
|-------|--|--|
| C0280 | Genforsikringsselskabets kode | Identifikationskode for genforsikringsselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge): — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. En specifik kode tildelt af selskabet skal være unik for det specifikke genforsikringsselskab og må ikke overlape andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden. Hvis der allerede findes en kode (f.eks. en national identifikator), anvendes den samme kode som identifikator konsistent over tid, indtil der findes en LEI-kode |
| C0290 | Genforsikringsselskabets kodeltype | Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringsselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0300 | Genforsikringsselskabets registrerede navn | Det registrerede navn på det genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. Det officielle navn på det risikobærende genforsikringsselskab er angivet i genforsikringsaftalen. Det er ikke tilladt at angive navnet på en genforsikringsmægler. Det er heller ikke tilladt at angive en generel betegnelse eller et ufuldstændigt navn, da internationale genforsikringsselskaber har flere driftsselskaber, som kan være baseret i forskellige lande. I tilfælde af puljeaftaler er det kun tilladt at angive navnet på puljen (eller puljeforvalteren), hvis puljen er en juridisk person. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0310 | Genforsikringsselskabets type | <p>Den type genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Direkte livsforsikringsselskab</p> <p>2 — Direkte skadesforsikringsselskab</p> <p>3 — Direkte forsikringsselskab, som tegner flere forsikringsklasser</p> <p>4 — Captive-forsikringsselskab</p> <p>5 — Internt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som først og fremmest fokuserer på at overtage risici fra andre forsikringsselskaber inden for koncernen)</p> <p>6 — Eksternt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som overtager risici fra andre selskaber end forsikringsselskaber inden for koncernen)</p> <p>7 — Captive-genforsikringsselskab</p> <p>8 — Special purpose vehicles (SPV'er)</p> <p>9 — Puljeenhed (hvor mere end et enkelt forsikrings- eller genforsikringsselskab er involveret)</p> <p>10 — Offentlig pulje</p> |
| C0320 | Hjemland | <p>Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor genforsikringsselskabet er meddelt tilladelse/licens.</p> |
| C0330 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>Vurdering af genforsikringsselskabet på referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes denne post ikke.</p> |
| C0340 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0330, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer). Denne post indberettes, når »Ekstern vurdering« (C0330) indberettes.</p> |
| C0350 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt genforsikringsselskabet. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| C0360 | Intern vurdering | Intern vurdering af genforsikringselskaber for selskaber, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modelberegninger. Hvis et selskab, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke. |

S.30.03 — Grundlæggende data om cederede genforsikringsprogrammer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for forsikrings- og genforsikringselskaber med et cederende genforsikrings- og/eller retrocessionsprogram, inklusive eventuel dækning fra statsstøttede genforsikringspuljeaftaler, eksklusive fakultative dækninger.

Dette skema udfyldes af forsikrings- og genforsikringselskaber, som overfører forsikringsrisikoen til genforsikringselskaber ved en genforsikringsaftale, hvis gyldighedsperiode omfatter eller overlapper næste indberetningsår, og som er kendt, når skemaet udfyldes. Hvis genforsikringsstrategien ændres væsentligt efter den pågældende dato, eller hvis genforsikringsaftalerne fornyes efter indberetningsdatoen og før den 1. januar i det efterfølgende år, skal oplysningerne i dette skema, hvis det er relevant, indgives på ny.

Dette skema bør kun indberettes, hvis de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det bedste skøn beregnet separat for livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0010 | Kode for genforsikringsprogram | Unik kode (selskabsspecifik), som omfatter alle de individuelle genforsikringsplaceringer og/eller -aftaler, som hører til det samme genforsikringsprogram. |
| C0020 | Identifikationskode for aftale | Identifikationskode, som alene identificerer aftalen, og som skal bevares i efterfølgende indberetninger; normalt det oprindelige aftalenummer registreret i selskabets regnskaber. |
| C0030 | Løbenummer for afsnit i aftalen | Løbenummer, som selskabet tildeler de forskellige afsnit i aftalen, hvis aftalen f. eks. omfatter mere end en enkelt branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, eller forskellige aktivitetsområder med forskellige grænser. Aftaler med forskellige betingelser betragtes som forskellige aftaler ved indgivelse af oplysninger og skal indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. Betingelserne for forskellige brancher, som er omfattet af den samme aftale, specificeres særskilt for hver branche under de enkelte nummererede afsnit. Aftaler, som omfatter forskellige genforsikringstyper (f.eks. et afsnit om kvoteandele og et andet om skadesexcedent) inden for den samme aftale, indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. Aftaler, som omfatter forskellige lag (layer) i det samme program, indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. |
| C0040 | Løbenummer for overskud i excedentkontrakter (»surplus«)/lag (»layer«) i program | Løbenummeret for overskud i excedentkontrakter/lag, hvis aftalen er en del af et større program. |
| C0050 | Mængdeangivelse af overskud i excedentkontrakter/lag i program | Den samlede mængdeangivelse for overskud i excedentkontrakter eller lag i det samme program, som omfatter den aftale, der indberettes. |
| C0060 | Finite reinsurance eller tilsvarende arrangementer | Identifikation af genforsikringsaftalen. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Utraditionel eller finite reinsurance (i tilfælde af en genforsikringsaftale eller et finansielt instrument, som ikke er direkte baseret på princippet om erstatning, eller som er baseret på en aftale, der er udfærdiget således, at den kun har en begrænset eller ingen påviselig mekanisme til risikooverførsel) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------|--|
| | | <p>2 — Andre end utraditionel eller finite reinsurance</p> <p>I tilfælde af finite reinsurance eller et lignende arrangement skal kun de poster udfyldes, som kan udfyldes.</p> |
| C0070 | Branche | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>2 — Indkomstsikring</p> <p>3 — Arbejdsskadeforsikring</p> <p>4 — Motoransvarsforsikring</p> <p>5 — Anden motorforsikring</p> <p>6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring</p> <p>7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>8 — Almindelig ansvarsforsikring</p> <p>9 — Kredit- og kaufionsforsikring</p> <p>10 — Retshjælpsforsikring</p> <p>11 — Assistance</p> <p>12 — Diverse økonomiske tab</p> <p>13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring</p> <p>15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring</p> <p>16 — Proportional motoransvarsgenforsikring</p> <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kaufionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsenforsikring.</p> <p>29 — Sygeforsikring</p> <p>30 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>32 — Anden livsforsikring</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livs-genforsikring.</p> <p>37 — Flere brancher (som defineret herunder)</p> <p>Yderligere bemærkninger:</p> <p>1) Hvis genforsikringsaftalen tilvejebringer dækning for mere end en enkelt branche, og forsikringsvilkårene er forskellige brancherne imellem, skal aftalen beskrives på flere rækker. På den første række indsættes udtrykket »Flere brancher«, og der gives en nærmere beskrivelse af aftalens overordnede vilkår (f.eks. beløb, der trækkes fra, og genikrafttrædelser), mens der på de efterfølgende rækker gives en nærmere beskrivelse af genforsikringsaftalens individuelle vilkår for hver af de relevante brancher.</p> <p>2) Hvis forsikringsvilkårene ikke er forskellige brancherne imellem, angives kun den væsentligste branche i henhold til Solvens II (baseret på et skøn over aftalens bruttopræmieindtægter).</p> <p>3) Flerårige aftaler med faste vilkår kan angives i de rækker, der anvendes til gyldighedsperioden.</p> |
| C0080 | Beskrivelse af den dækkede risikokategori | <p>Beskrivelse af aftalens væsentligste anvendelsesområde. Det vedrører hovedporteføljen, som er aftalens anvendelsesområde, og som normalt indgår som en del af beskrivelsen af aftalen (f.eks. »Industriejendomme« eller »Forpligtelser vedrørende bestyrelsesansvar«). Selskaber kan også henvise til, i hvilken forretningsenhed risikoen blev accepteret, hvis det har ført til andre aftalebetingelser (f.eks. »Distribution label A«).</p> <p>Beskrivelsen af den dækkede risikokategori er enhedsspecifik og ikke obligatorisk. Endvidere er udtrykket »risikokategori« ikke baseret på den terminologi, der anvendes i forbindelse med niveau 1 og 2, men kan betragtes som endnu en mulighed for at give yderligere oplysninger om den eller de givne forsikringsrisici.</p> |
| C0090 | Genforsikringsaftalens type | <p>Kode for genforsikringsaftalens type. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — kvoteandel</p> <p>2 — variabel kvoteandel</p> <p>3 — overskud i excedentkontrakter</p> <p>4 — skadesexcedent (pr. begivenhed og pr. risiko)</p> <p>5 — skadesexcedent (pr. risiko)</p> <p>6 — skadesexcedent (pr. begivenhed)</p> <p>7 — »back-up« for skadesexcedent (beskyttelse mod efterfølgende begivenheder, som visse katastrofer kan forårsage, f.eks. oversvømmelse og brand)</p> <p>8 — skadesexcedent med basisrisiko</p> <p>9 — genindsættelsesdækning</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>10 — aggregeret skadesexcedent</p> <p>11 — ubegrænset skadesexcedent</p> <p>12 — stop loss</p> <p>13 — andre proportionale aftaler</p> <p>14 — andre ikkeproportionale aftaler</p> <p>Andre proportionale aftaler (kode 13) og andre ikkeproportionale aftaler (kode 14) kan anvendes til kombinerede genforsikringsaftaler.</p> |
| C0100 | Medtagelse af genforsikringsdækning for katastrofer | <p>Angiv medtagelse af katastrofegarantier Anvend en eller en kombination (adskilt med »«) af følgende koder, afhængigt af om de opregnede katastroferisici er beskyttet under genforsikringsdækninger:</p> <p>1 — dækning udelukker alle katastrofegarantier</p> <p>2 — jordskælv, vulkanudbrud, flodbølge osv. er dækket</p> <p>3 — oversvømmelse er dækket</p> <p>4 — orkan, storm, osv. er dækket</p> <p>5 — andre risici, f.eks. frost, hagl, stærk vind er dækket</p> <p>6 — terrorisme er dækket</p> <p>7 — strejker, oprør, civile uroligheder, sabotage og folkelig opstand er dækket</p> <p>8 — samtlige ovennævnte risici er dækket</p> <p>9 — risici, som ikke på anden måde er medtaget blandt de opregnede risici, er dækket</p> |
| C0110 | Gyldighedsperiode (startdato) | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale træder i kraft. |
| C0120 | Gyldighedsperiode (slutdato) | <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale udløber.</p> <p>Hvis aftalens betingelser forbliver uændrede, når skemaet udfyldes, og selskabet ikke gør brug af opsigelsesklausulen, er udløbsdatoen den næste mulige udløbsdato.</p> |
| C0130 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved placering af genforsikringsaftalen. Samtlige beløb skal opgives i denne valuta for den særlige dækning, medmindre den nationale tilsynsmyndighed kræver andet. Hvis aftalen placeres i to forskellige valutaer, angives den vigtigste valuta. |
| C0140 | Type forsikringsmodel | <p>Den type forsikringsmodel, som anvendes til at danne sig et skøn over eksponeeringen i forbindelse med forsikringsrisikoens og over behovet for genforsikringsdækning. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Forsikringssum</p> <p>Det største beløb, som forsikringsselskabet kan blive forpligtet til at udbetale i henhold til den oprindelige police. Forsikringssummen skal også angives, hvis type forsikringsmodel ikke er relevant.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>2 — Størst mulige tab</p> <p>Det tab, som kan opstå ved en mere eller mindre tilfældig kombination af de mest uheldige omstændigheder; branden standses kun på grund af ikke passerbare genstande eller manglende materiale.</p> <p>3 — Størst sandsynlige tab</p> <p>Det er defineret som et skøn over det største tab på grund af en enkeltstående brand eller risiko, der kan forventes, idet det antages, at den mest uheldige enkeltstående hindring for primære private brandsikringssystemer gør sig gældende, men at sekundære sikringssystemer eller -organer (f.eks. en indsats fra beredskabsorganer og et privat og/eller offentligt brandkorps) fungerer som forventet. Katastrofesituationer, f.eks. eksplosioner på grund af et massivt udslip af brandfarlige gasser, som kunne omfatte store områder af driftsanlægget, detonation af massive sprængstoffer, seismiske forstyrrelser, flodbølger eller oversvømmelser, flystyrt og brandstiftelse på mere end et enkelt område indgår ikke i dette skøn. Denne definition er en kombination af det største mulige og det største skønnede tab, som normalt accepteres og ofte anvendes af forsikringsselskaber, genforsikringsselskaber og reassurancemæglere.</p> <p>4 — Størst skønnede tab</p> <p>Det tab, som med rimelighed kan forventes at blive påført som følge af de uforudsete forhold, der tages i betragtning, på grund af en enkeltstående hændelse, der anses for at være en mulighed under hensyntagen til de faktorer, der sandsynligvis vil forøge eller reducere tabets omfang, herunder dog ikke sådanne tilfældigheder og katastrofer, som kan være mulige, men som forbliver usandsynlige.</p> <p>5 — Andet</p> <p>andre forsikringsmodeller, der kan anvendes. Det skal i den regelmæssige tilsynsrapport forklares, hvilke »andre« typer forsikringsmodeller der anvendes.</p> <p>Selv om ovennævnte definitioner anvendes i branchen, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, »Forsikring og genforsikring mod brand og andre skader på ejendom«, kunne lignende definitioner eventuelt anvendes i forbindelse med andre brancher.</p> |
| C0150 | Skønnede underliggende præmieindtægter (skadesexcedent — skønnede underliggende præmieindtægter) | De skønnede underliggende præmieindtægter (ESPI), der er knyttet til aftaleperioden. Det er normalt præmiebeløbet for den portefølje, der er sikret i henhold til skadesexcedentaftaler; det er under alle omstændigheder det beløb, som lægges til grund for beregning af genforsikringspræmien ved anvendelse af satsen. Denne post indberettes kun for skadesexcedentaftaler. |
| C0160 | Aftales skønnede bruttopræmieindtægter (proportionale og ikkeproportionale) | Den præmie for 100 % af aftalen, der er knyttet til aftaleperioden. Dette beløb svarer til 100 % af den genforsikringspræmie, der skal betales til alle genforsikringsselskaber i aftaleperioden, inklusive den præmie, som svarer til ikkeplacerede andele. |
| C0170 | Aggregeret selvrisiko (beløb) | Selvriskobeløbet, dvs. yderligere tilbageholdelse, i tilfælde hvor tab kun dækkes af genforsikringsselskabet, når der er opstået kumulative tab i en bestemt størrelsesorden. Denne post indberettes kun, i givet fald, hvis C0180 ikke indberettes. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0180 | Aggregeret selvrisko (%) | Selvriskoprocentandelen, dvs. en yderligere tilbageholdelsesandel, i tilfælde hvor tab kun dækkes af genforsikringsselskabet, når der er opstået kumulative tab i en bestemt størrelsesorden. Denne post indberettes kun, i givet fald, hvis C0170 ikke indberettes. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. |
| C0190 | Tilbageholdelse eller prioritet (beløb) | Det beløb, der i en excedentkontrakt, en excess-loss-kontrakt af typen Working XL og en katastrofe-excess-loss-kontrakt er opført som tilbageholdelse eller prioritet. Angives særskilt for de forskellige brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0200 | Tilbageholdelse eller prioritet (%) | Den procentdel, der for aftaler om kvoteandel eller stop loss er anført som tilbageholdelse eller prioritet i genforsikringsaftalen. Angives særskilt for de forskellige brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. |
| C0210 | Begrænsning (beløb) | Det beløb, der er anført som begrænsning i genforsikringsaftalen. Angives særskilt for de forskellige brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Angiv »1« ved ubegrænset dækning. |
| C0220 | Begrænsning (%) | Den procentdel, der for aftaler om stop loss er anført som begrænsning i genforsikringsaftalen. Angives særskilt for de forskellige brancher, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Angiv »1« ved ubegrænset dækning. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. |
| C0230 | Største dækning pr. risiko eller begivenhed | Beløbet for den største dækning pr. risiko eller begivenhed. Hvis der for en kvoteandel eller et overskud i en excedentkontrakt er aftalt et maksimalt beløb for en begivenhed (f.eks. — storm), indberettes 100 % af beløbet. I alle andre tilfælde svarer beløbet til begrænsningen minus prioritet. Angiv »1« ved ubegrænset dækning. |
| C0240 | Største dækning pr. aftale | Beløbet for den største dækning pr. aftale. Hvis der for en kvoteandel eller et overskud i en excedentkontrakt er aftalt et maksimalt beløb for hele aftalen, indberettes 100 % af beløbet. Angiv »1« ved ubegrænset dækning. For skadesexcedent- eller stop loss-aftaler anføres den oprindelige beløbsramme (f.eks. årlige aggregerede grænser); den samlede dækning følger eventuelt også af oplysningerne under C0250. |
| C0245 | Dækning af et lag, der er omfattet af genforsikring. | Beløbet for den største dækning foret lag i en aftale. Angiv »1« ved ubegrænset dækning. For skadesexcedent- eller stop loss-aftaler anføres den oprindelige beløbsramme (f.eks. årlige aggregerede grænser); Hvis aftalen kun indeholder et lag, er denne celle lig med C0250. |
| C0250 | Antal genikrafttrædelser | Antal muligheder for at genoptage genforsikringens dækning. |
| C0260 | Beskrivelse af genikrafttrædelser | Beskrivelse af genikrafttrædelser for at genoptage genforsikringens dækning. Under denne post angives f.eks. »2 til 100 % plus 1 til 150 %« eller »uden beregning« |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0360 | Skadesexcedent sats 1 | Angiv den faste sats eller startsatsen i et system med glidende satser. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. Denne post indberettes kun for skadesexcedentaftaler. |
| C0370 | Skadesexcedent sats 2 | Angiv den højeste sats i et system med glidende satser. Procentsatsen skal indberettes som et decimaltal. Denne post indberettes kun for skadesexcedentaftaler. |
| C0380 | Skadesexcedent fast præmie | Angiv, om skadesexcedentens præmie er baseret på en fast præmie eller ikke. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — skadesexcedentens præmie baseret på en fast præmie 2 — skadesexcedentens præmie ikke baseret på en fast præmie Denne post indberettes kun for skadesexcedentaftaler. |
| C0390 | Glidende provision | Angiv, om der er anvendt glidende provision: En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ja 2 — Nej |
| C0400 | Minimumskvoteprosent for krav, som den glidende provision er afhængig af | Medtag minimumskvoteprosenten for krav, udtrykt i procent, som den glidende provision er afhængig af |
| C0410 | Maksimumskvoteprosent for krav, som den glidende provision er afhængig af | Medtag maksimumskvoteprosenten for krav, udtrykt i procent, som den glidende provision er afhængig af |
| C0420 | Mindste provision | Medtag den mindste provision som en procentsats. |
| C0430 | Største provision | Medtag den største provision som en procentsats. |
| C0440 | Forventet provision | Medtag den forventede provision som en procentsats. |

S.30.04 — Data om andele for cederede genforsikringsprogrammer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for forsikrings- og genforsikringsselskaber med et cederende genforsikrings- og/eller retrocessionsprogram, inklusive eventuel dækning fra statsstøttede genforsikringspuljeaftaler, eksklusive fakultative dækninger.

Dette skema udfyldes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, som overfører forsikringsrisikoen til genforsikringsselskaber ved en genforsikringsaftale, hvis gyldighedsperiode omfatter eller overlapper næste indberetningsår, og som er kendt, når skemaet udfyldes. Hvis genforsikringsstrategien ændres væsentligt efter den pågældende dato, eller hvis genforsikringsaftalerne fornyes efter indberetningsdatoen og før den 1. januar i det efterfølgende år, skal oplysningerne i dette skema, hvis det er relevant, indgives på ny.

Dette skema bør kun indberettes, hvis de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, overstiger 10 % af det bedste skøn beregnet separat for livsforsikrings- og skadesforsikringsvirksomhed.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0010 | Kode for genforsikringsprogram | Unik kode (selskabsspecifik), som omfatter alle de individuelle genforsikringsplaceringer og/eller -aftaler, som hører til det samme genforsikringsprogram. |
| C0020 | Identifikationskode for aftale | Identifikationskode, som alene identificerer aftalen, og som skal bevares i efterfølgende indberetninger; normalt det oprindelige aftalenummer registreret i selskabets regnskaber. |
| C0030 | Løbenummer for afsnit i aftalen | Løbenummer, som selskabet tildeler de forskellige afsnit i aftalen, hvis aftalen f. eks. omfatter mere end en enkelt branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, eller forskellige aktivitetsområder med forskellige grænser. Aftaler med forskellige betingelser betragtes som forskellige aftaler ved indgivelse af oplysninger og skal indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. Betingelserne for forskellige brancher, som er omfattet af den samme aftale, specificeres særskilt for hver branche under de enkelte nummererede afsnit. Aftaler, som omfatter forskellige genforsikringstyper (f.eks. et afsnit om kvoteandele og et andet om skadesexcedent) inden for den samme aftale, indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. Aftaler, som omfatter forskellige lag (layer) i det samme program, indberettes i forskellige afsnit i indberetningsskemaerne. |
| C0040 | Løbenummer for overskud i excedentkontrakter/lag i program | Løbenummeret for overskud i excedentkontrakter/lag, hvis aftalen er en del af et større program. |
| C0050 | Genforsikringsselskabets kode | Identifikationskode for genforsikringsselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge): — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. En specifik kode tildelt af selskabet skal være unik for det specifikke genforsikringsselskab og må ikke overlappe andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden. |
| C0060 | Genforsikringsselskabets kodelagtype | Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringsselskabets kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0100 | Genforsikringsselskabets andel (%) | Den procentdel af genforsikringsaftalen, som genforsikringsselskabet accepterer, angivet under C0050, udtrykt som en absolut procentdel af placeringen i henhold til aftale. Procentsatsen skal indberettes som decimaltal. |
| C0110 | Eksponering cederet for genforsikringsselskabets andel | Den eksponering, som er genforsikret med genforsikringsselskabet. Beløbet er baseret på den største dækning pr. risiko/begivenhed og beregnet ved hjælp af denne formel: Største dækning pr. risiko eller begivenhed (indberettet under C0230 i S.30.03) x Genforsikringsselskabets andel (%) (indberettet under C0100 i S.30.04). Angiv »- 1«, hvis C0230 i S.30.03 er ubegrænset. |
| C0120 | Type sikkerhedsstillelse (hvis relevant) | Type sikkerhed, der besiddes (hvis relevant). Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Kontantbeløb eller tilsvarende under forvaltning 2 — Kontantbeløb eller tilbageholdte midler |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>3 — Reimburs</p> <p>4 — Andet</p> <p>5 — Ingen</p> |
| C0130 | Beskrivelse af genforsikrings-selskabets maksimale hæftelse med sikkerhedsstillelse | Beskrivelse af genforsikrings-selskabets maksimale hæftelse med sikkerhedsstillelse vedrørende et bestemt punkt i aftalen (f.eks. 90 % af de forsikringsmæssige hensættelser eller 90 % af præmierne), hvis det er relevant. |
| C0140 | Kode for sikkerhedsstiller (hvis relevant) | <p>Angiv identifikationskoden ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0150 | Sikkerhedsstillers kodetype | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Kode for sikkerhedsstiller (hvis relevant)«.</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> |
| C0160 | Skønnet cederende genforsikringspræmie for genforsikrings-selskabets andel | <p>Den skønnede bruttogenforsikringspræmie for aftalen, som selskabet skal betale, i henhold til næste indberetningsår (N+1), for de enkelte genforsikrings-selskabers andel. Beløbet beregnes som følger:</p> <p>Eksempel 1: For kvoteandel og overskud i excedentkontrakter den andel, der indberettes under »Genforsikrings-selskabets andel« (C0100), multipliceret med »Aftales skønnede bruttopræmieindtægter« (C0160) indberettet i S.30.03.</p> <p>Eksempel 2: For aftaler vedrørende skadesexcedent, hvis aftalen er omfattet af en fast sats; den sats, der indberettes under »Skadesexcedent sats 1« (C0360) i S.30.03, multipliceret med »Skønnede underliggende præmieindtægter« (C0150), indberettet i S.30.03, multipliceret med den andel, der indberettes under »Genforsikrings-selskabets andel« (C0100).</p> <p>Eksempel 3: For aftaler vedrørende skadesexcedent, hvis aftalen er omfattet af en variabel sats; den sats, der indberettes under »Skadesexcedent sats 2« (C0370) i S.30.03, multipliceret med »Skønnede underliggende præmieindtægter« (C0150), indberettet i S.30.03, multipliceret med den andel, der indberettes under »Genforsikrings-selskabets andel« (C0100).</p> |
| C0170 | Kommentarer | Beskriv tilfælde, enten hvor genforsikrings-selskabets andel er underlagt andre betingelser end dem, der gælder for almindelige fakultative placeringer eller placeringer i henhold til aftale, eller for at tilvejebringe andre oplysninger, som selskabet eventuelt skal indberette til tilsynsmyndigheden. |
| | Oplysninger om genforsikrings-selskaber og mæglere | |
| C0180 | Genforsikrings-selskabets kode | <p>Identifikationskode for genforsikrings-selskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. <p>En specifik kode tildelt af selskabet skal være unik for det specifikke genforsikrings-selskab og må ikke overlappende andre koder, som selskabet har tildelt, eller LEI-koden.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0190 | Genforsikringselskabets kode-type | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringselskabets kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0200 | Genforsikringselskabets registrerede navn | <p>Det registrerede navn på det genforsikringselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. Det officielle navn på det risikobærende genforsikringselskab er angivet i genforsikringsaftalen. Det er ikke tilladt at angive navnet på en genforsikringsmægler. Det er heller ikke tilladt at angive en generel betegnelse eller et ufuldstændigt navn, da internationale genforsikringselskaber har flere driftsselskaber, som kan være baseret i forskellige lande.</p> <p>I tilfælde af puljeaftaler er det kun tilladt at angive navnet på puljen (eller puljeforvalteren), hvis puljen er en juridisk person.</p> |
| C0210 | Genforsikringselskabets type | <p>Den type genforsikringselskab, som forsikringsrisikoen er overført til.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Direkte livsforsikringselskab</p> <p>2 — Direkte skadesforsikringselskab</p> <p>3 — Direkte forsikringselskab, som tegner flere forsikringsklasser</p> <p>4 — Captive-forsikringselskab</p> <p>5 — Internt genforsikringselskab (genforsikringselskab, som først og fremmest fokuserer på at overtage risici fra andre forsikringselskaber inden for koncernen)</p> <p>6 — Eksternt genforsikringselskab (genforsikringselskab, som overtager risici fra andre selskaber end forsikringselskaber inden for koncernen)</p> <p>7 — Captive-genforsikringselskab</p> <p>8 — Special purpose vehicles (SPV'er)</p> <p>9 — Puljeenhed (hvor mere end et enkelt forsikrings- eller genforsikringselskab er involveret)</p> <p>10 — Offentlig pulje</p> |
| C0220 | Hjemland | <p>Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor genforsikringselskabet er meddelt tilladelse/licens.</p> |
| C0230 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>Vurdering af genforsikringselskabet på referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes denne post ikke.</p> <p>Denne post er ikke relevant for genforsikringselskaber, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> |
| C0240 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0230, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> |
| C0250 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt genforsikringselskabet. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|--|
| | | <p>Denne post er ikke relevant for genforsikringsselskaber, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |
| C0260 | Intern vurdering | Intern vurdering af genforsikringsselskaber for selskaber, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modelberegninger. Hvis et selskab, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke. |
| C0320 | Sikkerhedsstillers navn | <p>Sikkerhedsstillersens navn afhænger af, hvilken type sikkerhedsstillelse der er angivet under C0120.</p> <p>— Hvis sikkerhedsstillelsen er under forvaltning, er sikkerhedsstilleren forvaltningsselskabet.</p> <p>— Hvis sikkerhedsstillelsen er et kontantbeløb eller tilbageholdte midler, er det ikke nødvendigt at udfylde denne celle.</p> <p>— Hvis sikkerhedsstillelsen er en remburs, er sikkerhedsstilleren det finansielle institut, som tilvejebringer denne facilitet.</p> <p>— Hvis sikkerhedsstillelsen er andet, angives navnet kun, hvis det er relevant.</p> |

S.31.01 — Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema udfyldes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, hvis et beløb, der kan tilbagekræves, indregnes i forbindelse med genforsikringsselskabet (også selv om alle aftaler med det pågældende forsikringsselskab er ophørt).

Med skemaet indsamles der oplysninger om genforsikringsselskaber og ikke om særskilte aftaler. Samtlige cederede forsikringsmæssige hensættelser, inklusive hensættelser cederet i henhold til Finite reinsurance (som defineret i S.30.03 under C0060), skal være afsluttet. Hvis en SPV eller et Lloyd's-syndikat fungerer som genforsikringsselskab, skal SPV'et og syndikatet også opregnes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------------------------|---|
| C0040 | Genforsikringsselskabets kode | <p>Identifikationskode for genforsikringsselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <p>— LEI-kode (Legal Entity Identifier)</p> <p>— Specifik kode tildelt af selskabet.</p> |
| C0050 | Genforsikringsselskabets kode-type | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringsselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| C0060 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Præmiehensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder ikke-SLT-sygeforsikring | Genforsikringsselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for præmiehensættelser, beregnet som nutidsværdien af de forventede fremtidige ind- og udgående cash flow. |
| C0070 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Erstatningshensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder ikke-SLT-sygeforsikring | Genforsikringsselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for erstatningshensættelser. |
| C0080 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Forsikringsmæssige hensættelser vedrørende livsforsikring, herunder SLT-sygeforsikring | Genforsikringsselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0090 | Justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Justering pr. genforsikringsselskab for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. Justeringen beregnes særskilt og skal være i overensstemmelse med delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi. |
| C0100 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Resultatet af cederede forsikringsmæssige hensættelser (som skyldes erstatningshensættelser + præmiehensættelser + forsikringsmæssige hensættelser vedrørende skadesforsikring beregnet under et og forsikringsmæssige hensættelser vedrørende livsforsikring, herunder SLT-sygeforsikring), inklusive justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. |
| C0110 | Nettoutilgodehavender | Forfaldne beløb, der stammer fra: erstatninger udbetalt af forsikringsselskabet, men som endnu ikke er refunderet af genforsikringsselskabet, plus provision, som skal betales af genforsikringsselskabet, og andre tilgodehavender minus gæld til genforsikringsselskabet. Kontante indskud medregnes ikke og skal betragtes som modtagne garantier. |
| C0120 | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskabet | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskabet for at reducere genforsikringsselskabets modpartsrisiko. |
| C0130 | Finansielle garantier | Garantier modtaget af selskabet fra genforsikringsselskabet for at garantere betaling af selskabets forpligtelser (omfatter remburser, uudnyttede lånefaciliteter). |
| C0140 | Kontante indskud | Kontante indskud, som selskabet har modtaget fra genforsikringsselskaberne. |
| C0150 | Samlede modtagne garantier | Det samlede beløb af de forskellige typer garantier. Svarer til summen af de i C0120, C0130 og C0140 indberettede værdier. |
| C0155 | Valuta | Angiv i givet fald ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for genforsikringsbeløb, der kan tilbagekræves. Opdeling efter valuta kræves kun for at dække 90 % af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. For de resterende 10 % er det muligt at samle disse under »andre valutaer«. |
| Oplysninger om genforsikringsselskaber | | |
| C0160 | Genforsikringsselskabets kode | Identifikationskode for genforsikringsselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge): — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0170 | Genforsikringsselskabets kode-type | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringsselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0180 | Genforsikringsselskabets registrerede navn | <p>Det registrerede navn på det genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. Det officielle navn på det risikobærende genforsikringsselskab er angivet i genforsikringsaftalen. Det er ikke tilladt at angive navnet på en genforsikringsmægler. Det er heller ikke tilladt at angive en generel betegnelse eller et ufuldstændigt navn, da internationale genforsikringsselskaber har flere driftsselskaber, som kan være baseret i forskellige lande.</p> <p>I tilfælde af puljeaftaler er det kun tilladt at angive navnet på puljen (eller puljeforvalteren), hvis puljen er en juridisk person.</p> |
| C0190 | Genforsikringsselskabets type | <p>Den type genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Direkte livsforsikringsselskab</p> <p>2 — Direkte skadesforsikringsselskab</p> <p>3 — Direkte forsikringsselskab, som tegner flere forsikringsklasser</p> <p>4 — Captive-forsikringsselskab</p> <p>5 — Internt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som først og fremmest fokuserer på at overtage risici fra andre forsikringsselskaber inden for koncernen)</p> <p>6 — Eksternt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som overtager risici fra andre selskaber end forsikringsselskaber inden for koncernen)</p> <p>7 — Captive-genforsikringsselskab</p> <p>8 — Special purpose vehicles (SPV'er)</p> <p>9 — Puljeenhed (hvor mere end et enkelt forsikrings- eller genforsikringsselskab er involveret)</p> <p>10 — Offentlig pulje</p> |
| C0200 | Hjemland | <p>Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor genforsikringsselskabet er meddelt tilladelse/licens.</p> |
| C0210 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>Den faktiske/aktuelle vurdering, som indgår i selskabets overvejelser.</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes posten ikke, og genforsikringsselskabet identificeres som »9 — Der foreligger ingen vurdering« i kolonne C0230 (kreditkvalitetstrin).</p> <p>Denne post er ikke relevant for genforsikringsselskaber, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> |
| C0220 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0210, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <p>—</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------|---|
| C0230 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt genforsikringsselskabet. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |
| C0240 | Intern vurdering | <p>Intern vurdering af genforsikringsselskaber for selskaber, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modelberegninger. Hvis et selskab, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke.</p> |

S.31.02 — *Special Purpose Vehicles*

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

Dette skema er relevant for alle forsikrings- eller genforsikringsselskaber, der overfører risici til en special purpose vehicle (SPV), og det har til formål at sikre, at der gives tilstrækkelige oplysninger om SPV'er, der anvendes som et alternativ til almindelige genforsikringsaftaler til at overføre risici.

Skemaet skal anvendes til:

- a) SPV'er, der er defineret i artikel 13, nr. 26), og meddelt tilladelse i artikel 211, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF
- b) SPV'er, der opfylder betingelserne i artikel 211, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF
- c) SPV'er, der reguleres af tredjelandes tilsynsmyndigheder, hvis disse træffer foranstaltninger, som svarer til betingelserne i artikel 211, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF
- d) Andre SPV'er, der ikke er defineret som ovenfor, hvis risici overføres i henhold til aftaler af samme økonomiske substans som en genforsikringsaftale.

Skemaet vedrører de risikoreduktionsmetoder (anerkendte eller ikke), som (gen)forsikringsselskabet anvender, og som indebærer, at en SPV overtager risici fra det indberettende selskab i henhold til en genforsikringsaftale, eller overtager risici fra det indberettende selskab i henhold til en »genforsikringslignende« aftale.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|--|
| C0030 | SPV's interne kode | <p>Intern kode, som tildeles SPV'et af selskabet i denne rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode <p>Denne kode er unik for den enkelte SPV og forbliver konstant i efterfølgende indberetninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0040 | ID-kode for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | <p>For værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er og i forsikrings- og genforsikringssekskabers besiddelse angives ID-koden i denne rækkefølge, hvis den findes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-koden ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre »anerkendte« koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0050 | ID-kodetype for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |
| C0060 | Brancher med relation til SPV-securitisering | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskade-forsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaution-forsikring 10 — Rets-hjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|--|
| | | <p>13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling</p> <p>14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring</p> <p>15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring</p> <p>16 — Proportional motoransvarsgenforsikring</p> <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> <p>29 — Sygeforsikring</p> <p>30 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> <p>32 — Anden livsforsikring</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livsgenforsikring.</p> <p>37 — Flere brancher</p> <p>Hvis genforsikringsaftalen eller en lignende aftale tilvejebringer dækning for mere end en enkelt branche og forsikringsvilkårene er forskellige brancherne imellem, skal aftalen beskrives på flere rækker. På den første række indsættes udtrykket »Flere brancher«, og der gives en nærmere beskrivelse af aftalens overordnede vilkår, mens der på de efterfølgende rækker gives der en nærmere beskrivelse af genforsikringsaftalens individuelle vilkår for hver af de relevante brancher. Hvis forsikringsvilkårene ikke er forskellige brancherne imellem, angives kun den væsentligste branche i henhold til Solvens II.</p> |
| C0070 | Udløsende faktor(er) i SPV'et | <p>Angiv de udløsende faktorer, som SPV'en anvender som udløsende begivenheder, der forpligter SPV'et til at foretage udbetalinger til det cederende (gen)forsikrings-selskab. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Erstatning</p> <p>2 — Tab fra modellen</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>3 — Indeks eller parametre</p> <p>4 — Kombinationer (omfatter dele af ovennævnte mekanismer)</p> <p>5 — Andet</p> |
| C0080 | Aftalerelateret udløsende begivenhed | Angiv den særlige udløsende begivenhed, der forpligter SPV'en til at foretage udbetalinger til det cederende (gen)forsikringsselskab. Denne oplysning bør supplere oplysningen under »Type udløsende mekanisme(r) i SPV« og bør være tilstrækkeligt beskrivende til, at tilsynsmyndigheden kan identificere den konkrete udløsende begivenhed, f.eks. særlige vejr- eller stormrelaterede indekser for katastroferisici eller almindelige dødelighedstabeller for levetidsrisici. |
| C0090 | Samme udløsende begivenhed som i underliggende cedents portefølje? | Angiv, om den udløsende begivenhed, der er defineret i den underliggende (gen) forsikringspolice med den udløsende begivenhed for udbetaling, der er defineret i aftalen, er den samme som den udløsende begivenhed, der er defineret i SPV'et. Følgende udtømmende liste anvendes: <p>1 — Samme udløsende begivenhed</p> <p>2 — Anden udløsende begivenhed</p> |
| C0100 | Basisrisiko som følge af risikooverførsels opbygning | Angiv årsagerne til basisrisikoen (dvs. at den eksponering, der er omfattet af risikoreduktionsteknikken, ikke svarer til forsikrings- eller genforsikringsselskabets risikoeksponering) Følgende udtømmende liste anvendes: <p>1 — Ingen basisrisiko</p> <p>2 — Utilstrækkelig efterstillelse for værdipapirindehavere</p> <p>3 — Investorers mulighed for at gøre yderligere krav gældende over for cedent</p> <p>4 — Yderligere risici securitiseret efter meddelelse af tilladelse</p> <p>5 — Cedenter eksponeret mod udstedte værdipapirer</p> <p>9 — Andet</p> |
| C0110 | Basisrisiko som følge af aftalevilkår | Angiv den basisrisiko, der opstår som følge af aftalevilkår. <p>1 — Ingen basisrisiko</p> <p>2 — Væsentlig del af forsikrede risici ikke overført</p> <p>3 — Udløsende begivenhed ikke tilstrækkelig til at matche cedentens risikoeksponering</p> |
| C0120 | SPV-aktiver specifikt afgrænset (ring-fenced) til at indfri cedentspecifikke forpligtelser | SPV-aktiver, som er specifikt afgrænsede (ring-fenced) til den indberettende cedent, og som kan anvendes til at indfri de aftalerelaterede forpligtelser, som SPV'et har genforsikret udelukkende for den pågældende specifikke cedent (aktiver stillet som sikkerhed og specifik indregnet i SPV'ets balance i forhold til den påtagne forpligtelse). |
| C0130 | Andre ikkecedentspecifikke SPV-aktiver med eventuel mulighed for at gøre krav | SPV-aktiver (indregnet i SPV'ets balance), som ikke er direkte knyttet til den indberettende cedent, men med mulighed for at gøre krav. De omfatter SPV'ets »frie aktiver«, som eventuelt kan anvendes til at indfri den indberettende cedents forpligtelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|--|---|
| C0140 | Andre muligheder for at gøre krav som følge af securitisering | SPV'ets eventualaktiver (ikkebalanceførte), som ikke er direkte knyttet til den indberettende cedent, men med mulighed for at gøre krav. Det omfatter krav mod andre af SPV'ets modparter, herunder garantier, genforsikringsaftaler og derivatforpligtelser over for SPV'et indgået af SPV'ets eksponeringsleverende institut, værdipapirindehavere eller andre tredjeparter. |
| C0150 | Størst mulige antal samlede forpligtelser fra SPV's side i henhold til genforsikringspolice | Størst mulige antal samlede forpligtelser som følge af genforsikringsaftalen (cedentspecifik). |
| C0160 | SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser i hele indberetningsperioden | Angiv, om afdækningen fra risikoreduktionsteknikken kun kan anerkendes delvist, hvis modparten til en genforsikringsaftale ikke længere kan tilvejebringe effektiv og fortløbende risikooverførsel. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser 2 — SPV ikke fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser |
| C0170 | Aktuelle beløb, som kan tilbagekræves fra SPV | SPV-relaterede beløb, som kan tilbagekræves, og som indregnes i det indberettende selskabs Solvens II-balance (før justeringer for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse). De beregnes i overensstemmelse med kravene i artikel 41 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0180 | Væsentlige investeringer, som cedent besidder i SPV | Angiv, om cedenten besidder væsentlige investeringer i SPV'et, jf. artikel 210 i delegeret forordning (EU) 2015/35. 1 — Ikke relevant 2 — Investeringer, foretaget af SPV'et, som cedenten og/eller det eksponeringsleverende institut (hvis det ikke svarer til cedenten) disponerer over 3 — Investeringer, foretaget af SPV'et, som besiddes af cedenten (SPV'ets egenkapital, værdipapirer eller anden efterstillet gæld) 4 — Cedenten sælger genforsikring eller anden risikoreduktionsafdækning til SPV'et 5 — Cedenten har tilvejebragt SPV'et eller værdipapirindehavere garanti eller anden kreditforbedring 6 — Cedenten tilbageholder tilstrækkelig basisrisiko 9 — Andet. Ved eventuel indberetning skal instrumentet angives i celle C0030 og C0040. |
| C0190 | Forvaltes securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent af anden tredjepart end cedent/organiserende institut? | Angiv, om der findes securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent, der forvaltes af anden tredjepart end cedent/organiserende institut, jf. bestemmelserne i artikel 214, stk. 2, og artikel 326 i delegeret forordning (EU) 2015/35. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut 2 — Ikke forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut |
| Oplysninger om SPV | | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0200 | SPV's interne kode | <p>Intern kode, som tildeles SPV'et af selskabet i denne rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode <p>Denne kode er unik for den enkelte SPV og forbliver konstant i efterfølgende indberetninger.</p> |
| C0210 | Kodetype for SPV | <p>Angiv den kode, som anvendes under »SPV's interne kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0220 | SPV's juridiske karakter | <p>Angiv SPV-securingens juridiske karakter, jf. artikel 13, nr. 26), i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Udtømmende liste</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Truster 2 — Partnerskaber 3 — Selskaber med begrænset ansvar 4 — Andre former for juridiske personer end ovennævnte 5 — Ikke etableret som juridisk person |
| C0230 | SPV's navn | Angiv SPV'ets navn |
| C0240 | SPV's registreringsnr. | Registreringsnummer modtaget ved etablering af SPV'et som juridisk person. For SPV'er, der ikke er etableret som juridisk person, indberetter selskabet det identifikationsnummer eller tilsvarende nummer, som modtages fra tilsynsmyndigheden på godkendelsestidspunktet. |
| C0250 | Land, hvor SPV er godkendt | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor SPV'et er etableret og godkendt, hvis det er relevant. |
| C0260 | Betingelser for godkendelse af SPV | <p>Angiv betingelserne for godkendelse af SPV'en i henhold til artikel 211 i direktiv 2009/138/EF eller tilsvarende bestemmelse i retsakt. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — SPV godkendt i henhold til artikel 211, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF 2 — SPV godkendt i henhold til artikel 211, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF (omfattet af overgangsbestemmelser) 3 — SPV reguleret af tilsynsmyndighed i et tredjeland, hvor SPV'et opfylder krav, som svarer til kravene i artikel 211, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF 4 — SPV ikke omfattet af ovenstående |
| C0270 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>(Eventuel) vurdering af SPV'et, som selskabet tager højde for, og som er udstedt af et eksternt kreditvurderingsinstitut.</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes posten ikke, og SPV'et identificeres som »9 — Der foreligger ingen vurdering« i kolonne C0290 (kreditkvalitetstrin).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------|--|
| | | Denne post er ikke relevant for SPV'er, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes. |
| C0280 | Udpeget ECAI | Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0270, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer). |
| C0290 | Kreditkvalitetstrin | Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt SPV'et. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af selskabet. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 0 — Kreditkvalitetstrin 0 1 — Kreditkvalitetstrin 1 2 — Kreditkvalitetstrin 2 3 — Kreditkvalitetstrin 3 4 — Kreditkvalitetstrin 4 5 — Kreditkvalitetstrin 5 6 — Kreditkvalitetstrin 6 9 — Der foreligger ingen vurdering. |
| C0300 | Intern vurdering | Intern vurdering af SPV'et for selskaber, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modelberegninger. Hvis et selskab, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke. |

S.36.01 — Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder i en koncern, i forbindelse med kapitalandele, gæld, indbyrdes finansiering ⁽¹⁾ og overførsel af aktiver.

De omfatter, men er ikke begrænset til:

- egenkapital og andres kapitalposter, inklusive andele i tilknyttede enheder og aktier overført fra tilknyttede enheder i koncernen
- gæld, herunder obligationer, lån, sikret gæld og andre transaktioner af lignende karakter, f.eks. med periodiske forud fastsatte rente-, kupon- eller præmiebetalinger i en forud fastsat periode
- andre aktivoverførsler, f.eks. overførsel af ejendomme og overførsel af aktier fra andre selskaber, som ikke er knyttet til (dvs. uden for) koncernen.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

⁽¹⁾ Som fastsat i artikel 223 i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed.

Hvis der er to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Investors/långivers navn | Navnet på den enhed, der køber aktier eller låner penge til et tilknyttet selskab i koncernen, dvs. den enhed, der indregner transaktionen som et aktiv på sin balance (debit — balance). |
| C0030 | Identifikationskode for investor/långiver | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge, hvis den findes: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0031 | Kodetype for investor/långiver | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/långiver«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---|--|
| NC0040 | Sektoren for investor/långiver | <p>Hvis udsteder/långiver er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/långiver ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Udsteders/låntagers navn | Navnet på den enhed, der udsteder aktier/kapitalposter eller låner penge (udsteder gæld) dvs. den enhed, der indregner transaktionen som en forpligtelse eller som kapital på sin balance (kredit — balance). |
| C0060 | Identifikationskode for udsteder/låntager | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringssekskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal det finansielle konglomerat konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0061 | Kodetype for udsteder/låntager | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udsteder/låntager«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| NC0070 | Sektor for udsteder/låntager | <p>Hvis udsteder/låntager indgår i den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/låntager ikke indgår i den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives »andet selskab i koncernen«.</p> |
| NC0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---------------------------------|--|
| NC0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0100 | ID-kode for instrument | <p>Identifikationskoden for instrumentet (kapital, gæld osv.) mellem de to modparter ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være konsistent over tid. <p>Den kan være forskellig fra den koncerninterne transaktionskode under C0010.</p> |
| NC0101 | ID-kode for type instrument | <p>Type ID-kode anvendt under »ID-kode for instrument«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |
| NC0110 | Instrumenttype | <p>Angiv instrumenttypen.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Obligationer/Gæld 2 — Egenkapitaltype 3 — Anden aktivoverførsel |
| NC0120 | Instrument | <p>Angiv instrumentet. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Obligationer/Gæld — med sikkerhedsstillelse 2 — Obligationer/Gæld — uden sikkerhedsstillelse |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|--|--|
| | | 3 — Egenkapitaltype — aktier/kapitalandele 4 — Egenkapitaltype — andet 5 — Anden aktivoverførsel — ejendomme 6 — Anden aktivoverførsel — andet |
| NC0130 | Udstedelsesdato | Den dato, der kommer først af transaktions-/gældsudstedelsesdatoen eller den dato, fra hvilken den koncerninterne transaktion er effektiv, hvis forskellig fra udstedelsesdato. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| NC0140 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor transaktionen udløber/forfalder, hvis det er relevant. — For koncerninterne transaktioner uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«. — For uamortisable værdipapirer anvendes »9999-12-31« |
| NC0150 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen. |
| NC0160 | Beløb på transaktionsdatoen | Transaktionsbeløb indberettet på transaktionsdatoen |
| NC0170 | Beløb på indberetningsdatoen | Transaktionens udestående beløb på indberetningsdatoen, hvis det er relevant, f. eks. for gældsudstedelse, i koncernens indberetningsvaluta. Ved en fuldstændig førtidig afvikling/førtidig indfrielse er saldoen af det aftalerelaterede beløb nul. |
| NC0180 | Værdi af sikkerhedsstillelse | Sikkerhedsstillelsens værdi for gæld med sikkerhedsstillelse eller aktiverens værdi for koncerninterne transaktioner, der omfatter aktivoverførsel. |
| NC0190 | Udbytte/renter/kuponer og andre betalinger i indberetningsperioden | I denne celle gengives samtlige betalinger i forhold til de koncerninterne transaktioner, der er angivet i dette skema for indberetningsperioden (seks måneder forud for indberetningsdatoen). De omfatter, men er ikke begrænset til: — Udbytte i det indeværende år, herunder udbetalt eller uddelt, men ikke udbetalt, udbytte. — Udskudt udbytte fra tidligere år udbetalt i indberetningsperioden (dvs. udbetalt udskudt udbytte med indvirkning på P&L i indberetningsperioden). — Rentebetalinger i forhold til gældsinstrumenter. — Samtlige betalinger i forhold til de koncerninterne transaktioner, der er angivet i dette skema f.eks. udgifter ved aktivoverførsel. — Samlede supplerende beløb, hvis det er relevant, dvs. det samlede yderligere beløb investeret i indberetningsperioden, f.eks. yderligere indbetaling i forbindelse med delvist betalte aktier eller forøgelse af lån i perioden (når supplerende beløb indberettes som en særskilt post). |
| C0200 | Kupon-/rentesats | Rente- eller kuponsatsen udtrykt i procent, hvis det er relevant. For variable rentesatser omfatter det referencesatsen og rentesatsen herover. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------|---|
| C0210 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: <ul style="list-style-type: none"> — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armlængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.02 — *Koncerninterne transaktioner — Derivater*

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

I dette skema indberettes alle (væsentlige og meget væsentlige transaktioner og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes), koncerninterne transaktioner mellem det individuelle selskab og det blandede forsikringsholdingselskab og dets tilknyttede selskaber i relation til derivater. Betydelige koncerninterne transaktioner i forbindelse med derivater indberettes, hvis den regnskabsmæssige værdi af derivatet overstiger tærsklen. De omfatter, men er ikke begrænset til:

- renteaftaler, herunder swaps, forwards, futures og optioner
- valutakurskontrakter, herunder swaps, forwards, futures og optioner
- kontrakter af samme art som dem, der er nævnt i nærværende bilags punkt 1, litra a)-e), og i punkt 2, litra a)-d), med andre underliggende instrumenter eller indekser.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis der er to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|---|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---|--|
| C0020 | Investors/købers navn | Navnet på den enhed, som investerer i/køber derivatet, eller modparten med den lange position. Ved swaps er betaleren den, der betaler den faste rente og modtager den variable rente. |
| C0030 | Identifikationskode for investor/køber | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0031 | Kodetype for investor/køber | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/køber«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| NC0040 | Sektoren for investor/køber | <p>Hvis investor/køber er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« eller »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis investor/køber ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Udsteders/sælgers navn | Navnet på den enhed, som udsteder/sælger derivatet, eller modparten med den korte position. Ved swaps er modtageren den, der modtager de faste renter og betaler den variable rente. |
| C0060 | Identifikationskode for investor/sælger | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|----------------------------------|--|
| C0061 | Kodetype for udsteder/sælger | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udsteder/sælger«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| NC0070 | Finanssektor for investor/sælger | <p>Hvis udsteder/sælger er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/sælger ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| NC0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i cellen. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0100 | ID-kode for instrument | <p>Identifikationskoden for instrumentet (kapital, gæld osv.) mellem de to modparter ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være konsistent over tid. <p>Den kan være forskellig fra den koncerninterne transaktionskode under C0010.</p> |
| NC0101 | ID-kode for type instrument | <p>Type ID-kode anvendt under »ID-kode for instrument«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---------------------------|---|
| | | 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |
| NC0110 | Instrumenttype | Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Derivater — futures 2 — Derivater — forwards 3 — Derivater — optioner 4 — Derivater — andre 5 — Garantier — kreditrisikoafdækning 6 — Garantier — andre 7 — Swaps 8 — Andet En genkøbsaftale bør betragtes som en kontantforretning plus en forwardkontrakt. |
| NC0120 | Type afdækning | Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — credit default 2 — renter 3 — valuta 4 — andre |
| NC0130 | Formålet med instrumentet | Beskriv brugen af derivatet (mikro-/makroafdækning, effektiv porteføljevaltning). Mikroafdækning vedrører derivater, der dækker ét enkelt finansielt instrument, én enkelt forventet transaktion eller én enkelt forpligtelse. Makroafdækning vedrører derivater, der dækker et sæt finansielle instrumenter, forventede transaktioner eller forpligtelser. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Mikroafdækning 2 — Makroafdækning 3 — Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser 4 — Effektiv porteføljevaltning bortset fra »Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser«. 5 — Andet |
| NC0140 | Startdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor transaktionen foregår/derivatkontrakten handles. Ved rullende aftaler angives den oprindelige handelsdato. |
| NC0150 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den kontraktligt fastsatte dato for derivatkontraktens afslutning, hvad enten det er forfaldsdatoen, udløbsdatoen for optioner (europæiske eller amerikanske) osv. |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|--|---|
| NC0160 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen. |
| NC0170 | Notional værdi | <p>Det beløb, der er dækket eller eksponeret i forhold til derivatet på indberetningsdatoen, dvs. ultimobalancen, i koncernens indberetningsvaluta.</p> <p>For futures og optioner svarer det til aftalestørrelse ganget med antal aftaler. For swaps og forwards svarer det til aftalebeløbet. Hvis en transaktion er forfaldet/udløbet i indberetningsperioden før indberetningsdatoen, er det notional beløb på indberetningsdatoen nul.</p> |
| NC0180 | Regnskabsmæssig værdi | <p>Derivatets værdi på indberetningsdatoen som indberettet i selskabets balance.</p> <p>Hvis en transaktion er forfaldet/udløbet i indberetningsperioden før indberetningsdatoen, skal den regnskabsmæssige værdi på indberetningsdatoen være den maksimale regnskabsmæssige værdi for derivaterne, før transaktionen forfalder.</p> |
| NC0190 | Værdi af sikkerhedsstillelse | Værdi af den stillede sikkerhed på indberetningsdatoen (nul, hvis derivatet er afviklet), hvis det er relevant. |
| NC0200 | Identifikationskode for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet | <p>ID-kode for det underliggende aktiv eller en underliggende forpligtelse for derivatkontrakten. Denne post skal indberettes for derivater, der har et enkelt underliggende instrument eller indeks i selskabets portefølje.</p> <p>Et indeks betragtes som et enkelt instrument og skal indberettes.</p> <p>Identifikationskode for det underliggende instrument for derivatet i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — o ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — o Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — o Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid — o »Mange aktiver/forpligtelser«, hvis der er mere end ét underliggende aktiv eller én underliggende forpligtelse. <p>Hvis det underliggende instrument er et indeks, så indberettes koden for indekset.</p> |
| NC0201 | Kodetype for det aktiv eller den forpligtelse, der ligger til grund for derivatet | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|--|--|
| | | 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet Denne valgmulighed anvendes ligeledes i forbindelse med »Mange aktiver/forpligtelser« og indeks. |
| NC0210 | Navn på modpart, for hvilken der er købt kreditrisikoafdækning | Navnet på den modpart, for hvis misligholdelse der er købt risikoafdækning. |
| NC0220 | Swaps — Betalt rente ved en swap (for køber) | Rente betalt i henhold til swapaftalen (kun for renteswaps). |
| NC0230 | Swaps — Modtaget rente ved en swap (for køber) | Rente modtaget i henhold til swapaftalen (kun for renteswaps). |
| NC0240 | Swaps — Afleveret valuta ved en swap (for køber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for swapprisen (kun for valutaswaps). |
| C0250 | Swaps — Modtaget valuta ved en swap (for køber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for swappens nominelle beløb (kun for valutaswaps). |
| C0260 | Indtægter fra derivater | Nettoindtægter fra investering i eller køb af derivater. I henhold til det IFRS-baserede P&L angives både de realiserede og ikke-realiserede resultater her. Beløbene angives i deres rene værdi (sammenlignet med skemaet for kvartalsvis indberetning S.09.01. SII). Renterne indberettes i S. 36.05 Koncerninterne transaktioner — P&L. |
| C0270 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.03 — Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører de forsikringsoplysninger, som forsikrings- og genforsikringselskaber skal indgive mindst en gang om året.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn i forbindelse med ikkebalanceførte garantier.

Heri medregnes blandt andet:

- ikkebalanceførte garantier
- uudnyttede kreditfaciliteter
- aktiver, der er indkøbt i henhold til direkte forwards (valuta eller andet)
- salgs- og genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 12, stk. 3 og 5, i direktiv 86/635/EØF
- eventualforpligtelser.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden

— blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen

— blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis der er to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Navnet på garantistiller | Navnet på den enhed, der stiller den ikkebalanceførte garanti. |
| C0030 | Identifikationskode for garantistiller | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til garantistilleren, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildelt af det finansielle konglomerat. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0031 | Kodetype for garantistiller | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for garantistiller«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0040 | Garantistillers finansielle sektor | Hvis garantistiller er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«. Hvis garantistiller ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«. |
| C0050 | Modtagerens navn | Navnet på den enhed, der drager fordel af den ikkebalanceførte garanti. |
| C0060 | Identifikationskode for den begunstigede | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den begunstigede, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0061 | Kodetype for den begunstigede | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for den begunstigede«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0070 | Den begunstigedes finansielle sektor | Hvis den begunstigede er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«. Hvis den begunstigede ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«. |
| C0080 | Indirekte transaktioner | Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden. Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«. |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden. Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0100 | Transaktionstype | <p>Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — garantier</p> <p>2 — forpligtelser</p> <p>3 — remburs</p> <p>4 — uudnyttede kreditfaciliteter</p> <p>5 — aktiver, der er indkøbt i henhold til direkte forwards (valuta eller andet)</p> <p>6 — salgs- og genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 12, stk. 3 og 5, i direktiv 86/635/EØF</p> <p>7 — eventualforpligtelser</p> <p>8 — andet.</p> |
| C0110 | Transaktions udstedelsesdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken transaktionen/udstedelsen træder i kraft. |
| C0120 | Udløbsdato for den aftale, der ligger til grund for transaktionen | Angiv i givet fald ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken aftalen udløber. Hvis der ikke er nogen udløbsdato, angives »9999-12-31«. |
| C0130 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen. Hvis der er tale om to valutaer, angives begge i cellen »Bemærkninger C0200«. |
| C0140 | Udløsende begivenhed | En kort beskrivelse af begivenhed, der ville udløse transaktionen/betalingen/forpligtelsen/ingen, f.eks. begivenhed, der ville medføre en eventualforpligtelse. |
| C0150 | Transaktionsværdi på startdato | Værdi af transaktionen eller den stillede sikkerhed, indregnet i Solvens II-balancen. |
| C0160 | Transaktionsværdi på indberetningsdato | Værdi af transaktionen eller den stillede sikkerhed, indregnet i Solvens II-balancen pr. indberetningsdatoen. |
| C0170 | Højeste mulige værdi af eventualforpligtelser | Højeste mulige værdi, om muligt, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidige cash flow, der er nødvendige for at honorere eventualforpligtelsen frem til afløb, diskonteret med den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der er opført på Solvens II balancen. Summen af alle mulige cash flow, hvis de begivenheder, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier stillet af »garantistilleren« (C0020) over for den »begunstigede« (C0050) for at garantere betaling af selskabets forpligtelser (heri medregnes remburs og uudnyttede lånefaciliteter). Under denne post medregnes ikke beløb, der allerede er indberettet under C0150 og C0160. |
| C0180 | Værdi af garanterede aktiver | Værdi af de garanterede aktiver, for hvilke garantierne er modtaget. Sektorbestemte værdiansættelsesprincipper kan være relevante i dette tilfælde. |
| C0190 | Indtægter fra ikkebalanceførte poster | Indtægter i relation til hensættelser for ikkebalanceførte transaktioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------|---|
| C0200 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.04 — *Koncerninterne transaktioner — Forsikring og genforsikring*

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder. I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn i forbindelse med koncernintern forsikring og genforsikring.

Heri medregnes blandt andet:

- forsikringsaftaler for selskaber, der er omfattet af koncernen, indgået med forsikringselskaber inden for koncernen
- genforsikringsaftaler mellem tilknyttede selskaber i en koncern
- fakultativ genforsikring mellem tilknyttede selskaber i en koncern og
- alle andre transaktioner, som medfører overførsel af forsikringsrisici mellem tilknyttede selskaber i en koncern.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|---|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0020 | Navnet på forsikringstager/cedent | Det registrerede navn på den enhed, som har overført forsikringsrisikoen til et andet forsikringselskab eller genforsikringselskab inden for koncernen. |
| C0030 | Identifikationskode for forsikringstager/cedent | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0031 | Kode for forsikringstager/cedent | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/långiver«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Sektor for forsikringstager/cedent | <p>Hvis forsikringstager/cedenten er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis forsikringstager/cedenten ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Navn på forsikrings-/genforsikringselskabet | Det registrerede navn på det forsikrings-/genforsikringselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. |
| C0060 | Identifikationskode for forsikrings-/genforsikringselskabet | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0061 | Kodetype for forsikrings-selskab/genforsikrings-selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for forsikrings-/genforsikrings-selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0070 | Sektor for forsikrings-/genforsikrings-selskabet | <p>Den finansielle sektor for garantistilleren, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, dvs. »forsikrings- og genforsikrings-selskab«.</p> <p>Denne kolonne skal anvendes til en tilpasning i forhold til de skemaer, der er anvendt på niveauet for det finansielle konglomerat.</p> |
| C0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0100 | Transaktionstype | <p>Angiv aftale- eller kontrakttype. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — sygeforsikring</p> <p>2 — sygegenforsikring</p> |
| C0110 | Transaktion | <p>Hvis C0100 = genforsikring, angives typen af genforsikringsaftale/kontrakt. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — kvoteandel</p> <p>2 — variabel kvoteandel</p> <p>3 — overskud i excedentkontrakter</p> <p>4 — skadesexcedent (pr. begivenhed og pr. risiko)</p> <p>5 — skadesexcedent (pr. risiko)</p> <p>6 — skadesexcedent (pr. begivenhed)</p> <p>7 — »back-up« for skadesexcedent (beskyttelse mod efterfølgende begivenheder, som visse katastrofer kan forårsage, f.eks. oversvømmelse og brand)</p> <p>8 — skadesexcedent med basisrisiko</p> <p>9 — genindsættelsesdækning</p> <p>10 — aggregeret skadesexcedent</p> <p>11 — ubegrænset skadesexcedent</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | 12 — stop loss 13 — andre proportionale aftaler 14 — andre ikkeproportionale aftaler 15 — finansiell genforsikring 16 — fakultativ proportional 17 — fakultativ ikkeproportional Andre proportionale aftaler (kode 13) og andre ikkeproportionale aftaler (kode 14) kan anvendes til kombinerede genforsikringsaftaler. |
| C0120 | Startdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale eller -kontrakt træder i kraft. |
| C0130 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale udløber (dvs. den sidste dag, hvor den specifikke genforsikringsaftale eller -kontrakt er i kraft). Denne post skal ikke indberettes, hvis der ikke er nogen udløbsdato (f.eks. hvis aftalen er fortløbende og ophører, hvis en af parterne opsiges den). |
| C0140 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, hvori betalinger vedrørende den specifikke genforsikringsaftale eller -kontrakt skal finde sted. |
| C0150 | Dent maksimale dækningsbeløb for en transaktion | For aftaler af kvoteandels- eller excedentkontraktoverskudstypen skal 100 % af det maksimumsbeløb, der er fastsat for hele aftalen/kontrakten angives her (f.eks. 10 mio. EUR). I tilfælde af ubegrænset dækning anføres »-1«. Denne post skal indberettes i transaktionsvalutaen. |
| C0160 | Nettotilgodehavender | Beløbet stammer fra: erstatninger udbetalt af (gen)forsikringsselskabet, men som endnu ikke er refunderet af (gen)forsikringsselskabet, plus provision, som skal betales af (gen)forsikringsselskabet, plus andre tilgodehavender minus gæld til (gen)forsikringsselskabet. Kontante indskud medregnes ikke og skal betragtes som modtagne garantier. |
| C0170 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Samlet forfaldent tilgodehavende hos genforsikringsselskabet på indberetningsdatoen, hvori medregnes: Præmiehensættelser for den del af den fremtidige genforsikringspræmie, som allerede er betalt til genforsikringsselskabet Erstatningshensættelser for forsikringsselskabets udestående krav, som skal betales af genforsikringsselskabet, og/eller Forsikringsmæssige hensættelser for det beløb, der afspejler genforsikringsandelen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser. |
| C0180 | Teknisk genforsikringsresultat (for genforsikring) | Genforsikringsresultat (for den genforsikrede enhed): Den samlede provision fra genforsikring modtaget af den genforsikrede enhed med fradrag af bruttopræmier fra genforsikring indbetalt af den genforsikrede enhed plus erstatninger udbetalt af genforsikringsselskabet i indberetningsperioden plus det samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med fradrag af de samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, ved begyndelsen af indberetningsperioden. |
| C0190 | Præmier (for forsikring) | De samlede tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35. For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|--|
| C0200 | Erstatninger (for forsikring) | De samlede udbetalte erstatninger, brutto, i løbet af året, herunder skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210 | Branche | <p>Navn på den branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, som genforsikres.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kautionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring 21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring 22 — Proportional retshjælpsgenforsikring 23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance 24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. 28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring. 29 — Forsikring med gevinstandele 30 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring 31 — Anden livsforsikring |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------|---|
| | | 32 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser 33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser 34 — Livsgenforsikring. 35 — Sygeforsikring 36 — Sygegenforsikring — Hvis en genforsikringsaftale dækker mere end én branche, vælges den vigtigste branche ud fra ovenstående liste. |
| C0220 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.05 — **Koncerninterne transaktioner — Overskud og tab (P&L)**

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for individuelle enheder.

I skemaet indberettes alle koncerninterne P&L-transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn, eller P&L-transaktioner, der anses for at være betydelige eller meget betydelige koncerninterne transaktioner eller for at være transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes. Heri medregnes blandt andet:

- Gebyrer
- Provisioner
- Renter
- Udbytter

Koncernintern outsourcing eller intern omkostningsdeling, der fører til betydelige koncerninterne transaktioner skal indberettes.

Selv om renter og udbytte indberettes i S.36.01 og S.36.02, skal de også indberettes i S.36.05 P&L.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|---|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. Hvis den vedrører allerede nævnte transaktioner, anvendes den samme ID. |
| C0020 | Navnet på indtægtssiden | Det juridiske navn på den enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen. |
| C0030 | Identifikationskode for indtægtsside | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den enhed, der fik indtægten, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikrings-selskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0031 | Kodetype for indtægtsside | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for indtægtssiden«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Sektoren for indtægtssiden | Hvis enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«. <p>Hvis enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Navnet på udgiftssiden | Det juridiske navn på den enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|--|
| C0060 | Identifikationskode for indtægtsside | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den enhed, der skaffede indtægten, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge, hvis den findes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0061 | Kodetype for udgiftsside | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udgiftssiden«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0070 | Sektoren for udgiftssiden | <p>Hvis enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0100 | Transaktionstype | <p>Angiv typen af P&L-transaktion. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Gebyrer 2 — Provisioner 3 — Renter |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|---|
| | | 4 — Udbytter 5 — Omkostninger eller indtægter 6 — Andet |
| C0110 | Transaktion | Hvis relevant det instrument, hvormed indtægten eller udgiften er forbundet Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Obligationer/Gæld 2 — Egenkapitaltype 3 — Anden aktivoverførsel 4 — Derivater 5 — Ikkebalanceført post 6 — Koncernintern outsourcing, intern omkostningsdeling eller lejeaftaler. 7 — Andet |
| C0120 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, hvori betalinger vedrørende den specifikke P&L-transaktion. |
| C0130 | Transaktionsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor P&L-transaktionen påbegyndes. |
| C0140 | Beløb | Transaktionsbeløb eller -pris i henhold til aftale, i koncernens indberetningsvaluta. |
| C0150 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

BILAG III

Vejledning til indberetningsskemaer for koncerner

Dette bilag indeholder yderligere vejledning vedrørende skemaerne i bilag I til denne forordning. I første kolonne i tabellerne er angivet de poster, som skal indberettes, idet kolonnerne og rækkerne er anført, som de optræder i skemaet i bilag I.

Skemaer, som skal udfyldes i overensstemmelse med vejledningerne i de forskellige afsnit i dette bilag, benævnes »dette skema« i hele bilagets tekst.

Alle henvisninger til artikler bør henvise til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II), medmindre andet er anført.

S.01.01 — Indberetningens indhold*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchningsporteføljer og den resterende del på koncernniveau.

Når der er behov for en særlig begrundelse, skal forklaringen ikke indgives i indberetningsskemaet, men indgå i dialogen med de nationale kompetente myndigheder.

Når et skema indgives kun med »nuller« og uden tal, angives der i S.01.01 én af de »ikke indberettede« valgmuligheder.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| Z0010 | Ring-fenced fond/matchningsportefølge/resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølge eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølge 2 — Resterende del |
| Z0020 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0010 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchningsportefølge. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| C0010/R0010 | S.01.02 — Grundlæggende oplysninger — Generelt | Dette skema skal altid indgives. Den eneste mulighed er: 1 — Indberettet |
| C0010/R0020 | S.01.03 — Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølge 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0030 | S.02.01 — Balance | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0040 | S.02.02 — Passiver efter valuta | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0060 | S.03.01. — Ikkebalanceførte poster — Generelt | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen ikkebalanceførte poster</p> <p>3 — Ikke indberettet som følge af en værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser under tærsklen, og der er ikke givet eller modtaget nogen ubegrænset garanti, jf. vejledningerne til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0110 | S.05.01 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0120 | S.05.02 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter land | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0140 | S.06.02 — Liste over aktiver | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0150 | S.06.03 — Kollektive investeringsinstitutter — se igennem-metode | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen kollektive investeringsinstitutter</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet (i så fald skal der angives en særlig begrundelse)</p> |
| C0010/R0160 | S.07.01 — Strukturerede produkter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen strukturerede produkter</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0170 | S.08.01 — Åbne derivater | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen derivattransaktioner</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>7 — Indberettes ikke årligt, er indberettet for fjerde kvartal (denne mulighed er kun relevant for årlige indberetninger)</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0190 | S.09.01 — Indtægter/gevinster og tab i perioden | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0200 | S.10.01 — Værdipapirudlån og -genkøb | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen værdipapirudlån og -genkøb</p> <p>3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet</p> <p>6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0210 | S.11.01 — Aktiver, der besiddes som sikkerhed | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen aktiver, der besiddes som sikkerhed 6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0370 | S.22.01 — Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0410 | 23.01 — Kapitalgrundlag | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 6 — Undtaget i henhold til artikel 254, stk. 2 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0420 | S.23.02 — Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag opdelt efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital (tidligere benævnt tier 1, tier 2, og tier 3) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0430 | S.23.03 — Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0440 | S.23.04 — Liste over kapitalgrundlagselementer | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 3 — Indberettes ikke ifølge vejledningen til skemaet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0460 | S.25.01 — Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender standardformlen | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes (»PIM«)</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes (»IM«)</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0470 | S.25.05 — Solvenskapitalkrav — for koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0500 | S.26.01 — Solvenskapitalkrav — Markedsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0510 | S.26.02 — Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | | <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0520 | S.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0530 | S.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0540 | S.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0550 | S.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0560 | S.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da ingen forenklede beregninger anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0561 | S.26.08 — Solvenskapitalkrav — for koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0562 | S.26.09 — Intern model — Markeds- og kreditrisiko og følsomheder | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0563 | S.26.10 — Intern model — Kredithændelsesrisici, Porteføljeoversigt | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0564 | S.26.11 — Intern model — Nærmere oplysninger om kreditrisici for finansielle instrumenter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0565 | S.26.12 — Intern model — Kreditrisiko for ikke-finansielle instrumenter | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0566 | S.26.13 — Intern model — Skades- og sygeforsikring (ikke-SLT) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0567 | S.26.14 — Intern model — Livs- og sygeforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0568 | S.26.15 — Intern model — Operationel risiko | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0569 | S.26.16 — Intern model — Ændringer af modellen | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model, som omfatter disse risici, anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen eller en partiel intern model, som ikke omfatter disse risici, anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0570 | S.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, indberettes for ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0680 | S.31.01 — Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er) | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen genforsikring</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0690 | S.31.02 — Special Purpose Vehicles | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen SPV'er 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0700 | S.32.01 — Selskaber, der indgår i koncernen | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0710 | S.33.01 — Individuelle krav for forsikrings- og genforsikringselskaber | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0720 | S.34.01 — Individuelle krav vedrørende andre regulerede finansielle selskaber og andre ikkere-gulerede finansielle selskaber, herunder forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, da ingen ikke(gen)forsikringsvirksomhed indgår i koncernen 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0730 | S.35.01 — Bidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0740 | S.36.01 — Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, da det ikke er koncerninterne transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0750 | S.36.02 — Koncerninterne transaktioner — Derivater | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i derivater 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0760 | S.36.03 — Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i ikkebalanceførte poster og eventualforpligtelser 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0770 | S.36.04 — Koncerninterne transaktioner — Forsikring og genforsikring | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner i forsikring og genforsikring 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0775 | S.36.05 — Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen koncerninterne transaktioner 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0780 | S.37.01 — Risikokoncentration | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Indberettes ikke i overensstemmelse med den af den koncerntilsynsførende fastsatte tærskel 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0785 | S.37.02 — Risikokoncentration — Eksponering efter valuta, sektor, land | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0786 | S.37.03 — Risikokoncentration — Eksponering efter aktivklasse og vurdering | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0790 | SR.02.01 — Balance | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 14 — Ikke indberettet, da det drejer sig om en matchtilpasningsportefølje 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0840 | SR.25.01 — Solvenskapi- talkrav — Kun standard- formel | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet, da standardformlen anvendes 8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes 9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0855 | SR.25.05 — Solvenskapi- talkrav — for koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes 5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes 10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0870 | SR.26.01 — Solvenskapi- talkrav — Markedsrisici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen risici 8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes 9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes 11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes 16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF 17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes 0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse). |
| C0010/R0880 | SR.26.02 — Solvenskapi- talkrav — Modpartsrisici | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberettet 2 — Ikke indberettet, ingen risici 8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes 9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes 11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0890 | SR.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0900 | SR.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0910 | SR.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| | | <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0920 | SR.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0930 | SR.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, da ingen forenklede beregninger anvendes</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>16 — Indberettet efter pålæg i henhold til artikel 112 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |
| C0010/R0935 | SR.26.08 — Solvenskapitalkrav — for koncerner, der anvender en intern model | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>4 — Indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>5 — Indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>10 — Ikke indberettet, da standardformlen anvendes</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0940 | SR.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringskatastroferisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberettet</p> <p>2 — Ikke indberettet, ingen risici</p> <p>8 — Ikke indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>9 — Ikke indberettet, da en komplet intern model anvendes</p> <p>11 — Ikke indberettet, ingen ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>13 — Ikke indberettet, da kun metode 2 anvendes</p> <p>17 — Delvist indberettet, da en partiel intern model anvendes</p> <p>0 — Ikke indberettet, anden årsag (i så fald skal der angives en særlig begrundelse).</p> |

S.01.02 — Grundlæggende oplysninger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|-----------------------------|---|
| C0010/R0010 | Navn på deltagende selskab | Registreret navn på det deltagende forsikrings- og genforsikringsselskab eller forsikringsholdingselskab eller blandet finansielt holdingselskab, der er moderselskab i forsikrings- eller genforsikringskoncernen. Det skal være konsistent i alle indberetninger. |
| C0010/R0020 | Koncernidentifikationskode | Identifikationskoden for det deltagende selskab ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI). |
| C0010/R0025 | Sammenslutningens navn | Denne post svarer til koncernens registrerede navn |
| C0010/R0050 | Koncerntilsynsførendes land | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for den koncerntilsynsførendes land. |
| C0010/R0060 | Oplysninger om koncerndel | <p>Angiv om, oplysningerne vedrører en koncerndel, jf. artikel 216 i direktiv 2009/138/EF. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ikke oplysninger om koncerndel</p> <p>2 — Oplysninger om koncerndel</p> |
| C0010/R0070 | Indberetningssprog | Angiv ISO 639-1-koden (2 bogstaver) for det sprog, der anvendes til indberetning af oplysninger. |
| C0010/R0080 | Indberetningsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor indberetningen indgives til tilsynsmyndigheden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0081 | Regnskabsårets udgang | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor selskabets regnskabsår slutter, f.eks. 2017-12-31. |
| C0010/R0090 | Referencedato for indberetning | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, som er den sidste dag i indberetningsperioden. |
| C0010/R0100 | Regelmæssig indberetning/ad hoc-indberetning | Angiv, om indberetningen vedrører regelmæssig indberetning eller ad hoc-indberetning. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Regelmæssig indberetning 2 — Ad hoc-indberetning 4 — Tom indberetning |
| C0010/R0110 | Indberetningsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, som beløbene i de enkelte indberetninger oplyses i. |
| C0010/R0120 | Regnskabsstandarder | Angiv, hvilke regnskabsstandarder der anvendes til indberetningen af poster i S.02.01, værdiansættelse af regnskabet. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Internationale regnskabsstandarder (IFRS) 2 — Lokale generelt accepterede regnskabsprincipper (GAAP) |
| C0010/R0130 | Beregningsmetode for koncernens solvenskapitalkrav (SCR) | Angiv, hvilken metode der anvendes til at beregne koncernens solvenskapitalkrav. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Standardformel 2 — Partiel intern model 3 — Komplet intern model |
| C0010/R0140 | Anvendelse af koncernspecifikke parametre | Angiv, om koncernen indberetter tal under anvendelse af koncernspecifikke parametre. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Der anvendes koncernspecifikke parametre 2 — Der anvendes ikke koncernspecifikke parametre |
| C0010/R0150 | Ring-fenced fonde | Angiv, om koncernen indberetter virksomhed efter ring-fenced fonde. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Der indberettes virksomhed efter ring-fenced fonde 2 — Der indberettes ikke virksomhed efter ring-fenced fonde |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0160 | Beregningsmetode for koncernsolvens | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at beregne koncernsolvensen. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Kun metode 1 anvendes</p> <p>2 — Kun metode 2 anvendes</p> <p>3 — En kombination af metode 1 og metode 2 anvendes</p> |
| C0010/R0170 | Matchtilpasning | <p>Angiv, om koncernen indberetter tal under anvendelse af matchtilpasning. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes matchtilpasning</p> <p>2 — Der anvendes ikke matchtilpasning</p> |
| C0010/R0180 | Volatilitetsjustering | <p>Angiv, om koncernen indberetter tal under anvendelse af volatilitetsjustering. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes volatilitetsjustering</p> <p>2 — Der anvendes ikke volatilitetsjustering</p> |
| C0010/R0190 | Overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter | <p>Angiv, om koncernen indberetter tal under anvendelse af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter</p> <p>2 — Der anvendes ikke overgangsforanstaltninger vedrørende risikofrie renter</p> |
| C0010/R0200 | Overgangsforanstaltning vedrørende forsikringsmæssige hensættelser | <p>Angiv, om koncernen indberetter tal under anvendelse af overgangsfradraget i forsikringsmæssige hensættelser. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Der anvendes overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser</p> <p>2 — Der anvendes ikke overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser</p> |
| C0010/R0210 | Første indberetning eller genindberetning | <p>Angiv, om det drejer sig om en første indberetning af oplysninger eller en genindberetning af oplysninger vedrørende en tidligere indberetningsreferencedato. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Første indberetning</p> <p>2 — Genindberetning</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0250 | Fritagelse fra indberetning af ECAI-oplysninger | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fritaget for aktiver (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7)</p> <p>2 — Fritaget for aktiver (på grundlag af outsourcing)</p> <p>3 — Fritaget for derivater (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7)</p> <p>4 — Fritaget for derivater (på grundlag af outsourcing)</p> <p>5 — Fritaget for aktiver og derivater (på grundlag af artikel 35, stk. 6 og 7)</p> <p>6 — Fritaget for aktiver og derivater (på grundlag af outsourcing)</p> <p>0 — Ikke fritaget</p> |
| C0010/R0255 | Direkte URL-link til det websted, hvor rapporten om solvens og finansiell situation er offentliggjort | <p>Inkluder den direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation (SFCR) svarende til den referencedato for indberetning, jf. C0010/R0081 »Regnskabsårets udgang«, som vil blive offentliggjort.</p> <p>Hvis selskabet ikke har noget websted, indberettes det som »SELSKAB UDEN WEBSTED«.</p> |
| C0010/R0260 | Direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation | <p>Inkluder den direkte webadresse til download af rapporten om solvens og finansiell situation (SFCR) svarende til den referencedato for indberetning som anført i C0010/R0081 »Regnskabsårets udgang«.</p> <p>Webadressen skal føre direkte til en fil, der indeholder SFCR, og ikke til et websted.</p> <p>Alternativt, hvis SFCR allerede foreligger på datoen for indberetning, eller hvis rapporten ikke er offentliggjort på et websted, skal filen indgå i den årlige indberetning, og i denne celle skal én af følgende valgmuligheder udvælges:</p> <p>»SFCR-fil leveret«</p> <p>»SFCR-fil ikke leveret«</p> <p>Hvis »fil ikke leveret« er valgt, skal der vedlægges en forklaring til den nationale kompetente myndighed.</p> |
| C0010/R0270 | Captive-virksomhed | <p>Angiv om et selskab tilhørende koncernen udfører captive-virksomhed i overensstemmelse med artikel 13 i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Captive-virksomhed</p> <p>2 — Ingen captive-virksomhed</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0280 | Afviklingsvirksomhed (Run-Off Business) | <p>Angiv, om et selskab tilhørende koncernen ikke længere indgår nye forretninger for en specifik branche, men stadig har aftaler, der hører til den pågældende branche.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Selskaber, der afvikler en portefølje af forsikringsaftaler, men ikke hele deres forretningsvirksomhed (delvis afviklende selskab eller selskab med portefølje under afvikling)</p> <p>2 — Selskaber, der afvikler hele deres (hidtidige) forretningsvirksomhed (komplet afviklende selskab)</p> <p>3 — Selskaber med en særlig model for afviklingsvirksomhed (specialiseret afviklingsvirksomhed) — selskaber eller koncerner, hvis forretningsmodel består i aktiv erhvervelse af såkaldte legacy-porteføljer eller hele forsikringstagere under afvikling.</p> <p>4 — Ingen afviklingsvirksomhed</p> |
| C0010/R0290 | Fusioner og overtagelser i perioden | <p>Angiv, om fusioner og overtagelser eller afhændelse af aktiviteter, der påvirker indberettede oplysninger, fandt sted i koncernen under indberetningsperioden.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — Nej</p> |

S.01.03 — Grundlæggende oplysninger — Ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Alle ring-fenced fonde og matchningsporteføljer bør angives, uanset om de er væsentlige for indberetningen af oplysninger.

I den første tabel indberettes alle ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer. Hvis en ring-fenced fond har en matchningsportefølje, der ikke dækker hele den ring-fenced fond, angives tre fonde, en for den ring-fenced fond, en for matchtilpasningsporteføljen i den ring-fenced fond og en for fondens resterende del (omvendt i de tilfælde, hvor en matchtilpasningsportefølje har en ring-fenced fond).

I den anden tabel forklares forbindelserne mellem fondene som forklaret i det foregående afsnit. Kun fonde med sådanne forbindelser indberettes i den anden tabel.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.

- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | Liste over alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer (overlapning tilladt) | |
| C0010 | Registreret navn på selskab | Det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder den ring-fenced fund/matchtilpasningsporteføljen. |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | Selskabets identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Hvis selskabet anvender muligheden »Specifik kode«, skal følgende tages i betragtning: <ul style="list-style-type: none"> — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal den konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Fonds-/porteføljenummer | Nummer, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer, der tildeles hver ring-fenced fond og matchningsportefølje. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de ring-fenced fonde og matchningsporteføljen i andre skemaer. |
| C0050 | Navn på ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje | Angiv navnet på den ring-fenced fond og matchtilpasningsporteføljen. Når det er muligt (hvis fonden er knyttet til et kommercielt produkt), anvendes det kommercielle navn. Hvis det ikke er muligt, f.eks. hvis fonden er knyttet til flere kommercielle produkter, skal der anvendes et andet navn. Navnet skal være unikt og konsistent over tid. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0060 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del af en fond | <p>Angiv, om det drejer sig om en ring-fenced fond eller en matchningsportefølje. I de tilfælde, hvor der indgår andre fonde i én fond, skal i denne celle angives typen af hver fond eller afdeling. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond</p> <p>2 — Matchningsportefølje</p> <p>3 — Resterende del af en fond</p> |
| C0070 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | <p>Angiv, om den udpegede fond indeholder andre fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fond, hvori der indgår andre fonde</p> <p>2 — Ikke en fond, hvori der indgår andre fonde</p> <p>Kun »moderfonden« angives under valgmulighed 1.</p> |
| C0080 | Materiale | <p>Angiv, om den ring-fenced fond eller en matchningsportefølje er væsentlig med henblik på detaljeret indberetning af oplysninger. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Væsentlig</p> <p>2 — Ikke væsentlig</p> <p>I tilfælde af fonde, hvori der indgår andre fonde, skal denne post kun indberettes for »moderfonden«.</p> |
| C0090 | Artikel 304 | <p>Angiv, om den ring-fenced fond falder ind under Solvens II-direktivets artikel 304. En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond omfattet af artikel 304 — med mulighed for delmodulet for aktierisici</p> <p>2 — Ring-fenced fond omfattet af artikel 304 — uden mulighed for delmodulet for aktierisici</p> <p>3 — Ring-fenced fond ikke omfattet af artikel 304</p> |
| | Liste over ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0100 | Antal ring-fenced fonde/ matchtilpasningsporteføljer med afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | I forbindelse med de fonde, hvori der indgår andre fonde (mulighed 1 indberettet under post C0070), angives det under post C0040 anførte nummer. Fonden gentages i så mange rækker, som der kræves for at indberette de omfattede fonde. |
| C0110 | Antal afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Angiv antallet af fonde, der indgår i andre fonde, som anført under post C0040. |
| C0120 | Afdelinger af ring-fenced fonde/matchtilpasningsportefølje | Angiv arten af den fond, der indgår i andre fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond 2 — Matchningsportefølje |

S.02.01 — Balance

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde og den resterende del.

Dette skema anvendes, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering). Besiddelser i tilknyttede selskaber, som ikke konsolideres række for række i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) eller c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, herunder de besiddelser i tilknyttede selskaber, der er omfattet af metode 2, når der anvendes en kombination af metoder, medregnes i posten »Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser«.

Skema SR.02.01 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal udfyldes under anvendelse af værdiansættelsesprincipperne i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder udstedt i henhold til direktiv 2009/138/EF og EIOPA's retningslinjer.

Hvad angår kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) anvendes de indregnings- og værdiansættelsesmetoder, som koncernerne anvender i deres lovpligtige regnskaber i overensstemmelse med lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP. Denne kolonne er som standard obligatorisk. I de konkrete tilfælde, hvor koncernen ikke udarbejder officielle årsregnskaber i overensstemmelse med lokale GAAP eller IFRS, bør den konkrete situation drøftes med den koncerntilsynsførende. I skema SR.02.01 anvendes denne kolonne kun, hvis det i henhold til national lovgivning er et krav, at der udarbejdes regnskaber for ring-fenced fonde.

Hovedreglen er, at hver post skal indberettes særskilt i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi«.

Der er imidlertid indsat stiplede rækker i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« for at muliggøre indberetning af aggregerede tal, hvis de individuelle tal ikke foreligger.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | <i>Aktiver</i> | |
| Z0020 | Ring-fenced fond eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fondsnummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret eller koden for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af koncernen og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller portefølje-nummer eller den kode, der er indberettet i andre skemaer. |
| C0020/R0010 | Goodwill | Immaterielle aktiver, som opstår ved en virksomhedssammenslutning, og som repræsenterer den økonomiske værdi af aktiver, der ikke kan identificeres individuelt eller indregnes separat i en virksomhedssammenslutning. |
| C0020/R0020 | Udskudte anskaffelsesomkostninger | Anskaffelsesomkostninger, som vedrører kontrakter, der er i kraft på balancedatoen, og som overføres fra én indberetningsperiode til efterfølgende indberetningsperioder, i forbindelse med ikkeudløbne risikoperioder. I forbindelse med livsforsikringsvirksomhed udskydes anskaffelsesomkostninger, når det er sandsynligt, at de vil blive genindvundet. |
| C0010-C0020/R0030 | Immaterielle aktiver | Immaterielle aktiver, som ikke er goodwill. Et identificerbart, ikkemonetært aktiv uden fysisk substans. |
| C0010-C0020/R0040 | Udskudte skatteaktiver | Udskudte skatteaktiver er indkomstskatter, der i fremtidige regnskabsår vil reducere skattebetalinger som følge af: a) fradragsberettigede midlertidige forskelle b) fremførbare uudnyttede skattemæssige underskud og/eller c) fremførbare uudnyttede skattemæssige fradrag. |
| C0010-C0020/R0050 | Pensionsmæssigt overskud | Det samlede nettooverskud relateret til medarbejdernes pensionsordning. |
| C0010-C0020/R0060 | Materielle anlægsaktiver, som besiddes til eget brug | Materielle aktiver bestemt til permanent brug og ejendomme, der besiddes af koncernen til eget brug. Heri medregnes også ejendomme til eget brug under opførelse. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0020/ R0070 | Investeringer (bortset fra aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Det samlede beløb for investeringer, undtagen aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler. |
| C0010-C0020/ R0080 | Ejendomme (bortset fra til eget brug) | Værdien af ejendomme (bortset fra til eget brug). Heri medregnes også ejendomme under opførelse bortset fra til eget brug. |
| C0010-C0020/ R0090 | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser | <p>Kapitalinteresser som defineret i artikel 13, nr. 20), og besiddelser i tilknyttede selskaber som defineret i artikel 212, stk. 1, litra b), i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Når dele af aktiverne i forbindelse med kapitalinteresser og tilknyttede selskaber vedrører unit-linked og indeksregulerede aftaler, skal disse dele indberettes under »Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler« i C0010—C0020/R0220.</p> <p>I besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser på koncernniveau, medregnes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — besiddelser i tilknyttede forsikrings- eller genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, som ikke er datterselskaber af moderselskabet, jf. artikel 335, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35 — besiddelser i tilknyttede selskaber i andre finansielle sektorer, jf. artikel 335, stk. 1, litra e), i delegeret forordning (EU) 2015/35 — andre tilknyttede selskaber, jf. artikel 335, stk. 1, litra f), i delegeret forordning (EU) 2015/35 — forsikrings- eller genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering (hvis der anvendes en kombination af metoder). |
| C0010-C0020/ R0100 | Aktier | <p>Det samlede beløb for aktier, noterede og unoterede.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, angives under denne post summen.</p> |
| C0010-C0020/ R0110 | Aktier — noterede | <p>Kapitalandele, som repræsenterer selskabskapital, f.eks. ejerskabet i et selskab, og som handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, jf. direktiv 2004/39/EF.</p> <p>Heri medregnes ikke besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, indberettes denne post ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|----------------------------|---|
| C0010-C0020/ R0120 | Aktier — unoterede | <p>Kapitalandele, som repræsenterer selskabskapital, f.eks. ejerskabet i et selskab, og som ikke handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, jf. direktiv 2004/39/EF.</p> <p>Heri medregnes ikke besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem noterede og unoterede aktier, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010-C0020/ R0130 | Obligationer | <p>Det samlede beløb for statsobligationer, erhvervsobligationer, strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling for obligationer, angives under denne post summen.</p> |
| C0010-C0020/ R0140 | Statsobligationer | <p>Obligationer udstedt af offentlige myndigheder, uanset om det er centralregeringer, overnationale regeringsinstitutioner, regionale regeringer eller lokale myndigheder, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, multilaterale udviklingsbanker omhandlet i artikel 117, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 eller internationale organisationer omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, regionale regeringer eller lokale myndigheder opført i artikel 1 i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, hvor garantien opfylder kravene i artikel 215 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010-C0020/ R0150 | Erhvervsobligationer | <p>Obligationer udstedt af selskaber</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010-C0020/ R0160 | Strukturerede værdipapirer | <p>Hybride værdipapirer, der kombinerer fastforrentede værdipapirer (med afkast i form af faste betalinger) med en række derivatkomponenter. Fastforrentede værdipapirer, der er udstedt af suveræne regeringer, er ikke omfattet af denne kategori. Vedrører værdipapirer, der omfatter enhver kategori af derivater, herunder credit default swaps (CDS'er), constant maturity swaps (CMS'er) og credit default-optioner (CDOp'er).</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0020/ R0170 | Sikrede værdipapirer | <p>Værdipapirer, hvis værdi og betalinger er afledt af en portefølje af underliggende aktiver. Omfatter værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver (Asset Backed securities –ABS'er), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom (Mortgage Backed securities – MBS'er), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsjendom (Commercial Mortgage Backed securities – CMBS'er), strukturerede kreditobligationer (Collateralised Debt Obligations – CDO'er), collateralised loan obligations (CLO'er) og collateralised mortgage obligations (CMO'er).</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem obligationer, strukturerede produkter og sikrede værdipapirer, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0010-C0020/ R0180 | Kollektive investeringsinstitutter | Et »kollektivt investeringsinstitut«: et institut for kollektiv investering i værdipapirer (UCITS) som defineret i artikel 1, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF eller en alternativ investeringsfond (AIF) som defineret i artikel 4, stk. 1, litra a), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU. |
| C0010-C0020/ R0190 | Derivater | <p>Et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:</p> <p>a) Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikkefinansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).</p> <p>b) Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.</p> <p>c) Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.</p> <p>Derivatets Solvens II-værdi på indberetningsdatoen indberettes kun her, hvis den er positiv (i tilfælde af negativ værdi, se R0790).</p> |
| C0010-C0020/ R0200 | Indskud, bortset fra likvider | Indskud, bortset fra likvider, som ikke kan anvendes til foretage betalinger inden en bestemt forfaldsdato, og som ikke kan konverteres til kontanter eller konverterbare indskud uden væsentlige begrænsninger eller sanktioner. |
| C0010-C0020/ R0210 | Øvrige investeringer | Øvrige investeringer, der ikke allerede er omfattet af ovenstående investeringer. |
| C0010-C0020/ R0220 | Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler | Aktiver, der besiddes i forbindelse med indeksregulerede og unit-linked aftaler (klassificeret som branche 31, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0010-C0020/ R0230 | Lån, herunder realkreditlån | <p>Det samlede beløb for lån, herunder realkreditlån, dvs. finansielle aktiver, der skabes, når koncerner udlåner midler, enten med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling for lån, herunder realkreditlån, angives under denne post summen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0020/ R0240 | Policelån | Lån ydet til forsikringstagere, sikret ved policer (underliggende forsikringsmæssige hensættelser). Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke. |
| C0010-C0020/ R0250 | Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer | Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer (fysiske personer) med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke. |
| C0010-C0020/ R0260 | Andre lån, herunder realkreditlån | Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer (øvrige, kan ikke klassificeres under post R0240 eller R0250), med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem policelån, lån og realkreditlån til fysiske personer og andre lån og realkreditlån, indberettes denne post ikke. |
| C0010-C0020/ R0270 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler fra: | Beløb i alt, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Det svarer til genforsikringsandelen af forsikringsmæssige hensættelser (herunder finite reinsurance og SPV'er). For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) bør denne celle indeholde alle forventede betalinger fra genforsikringsselskaber til selskabet (eller omvendt) svarende til betalinger, der endnu ikke er foretaget af selskabet til forsikringstagere (eller af forsikringstagere til selskabet). Alle forventede betalinger fra genforsikringsselskaber til selskabet (eller omvendt) svarende til betalinger, der endnu ikke er foretaget af selskabet til forsikringstagere (eller af forsikringstagere til selskabet), bør medregnes i tilgodehavender fra genforsikring (eller forpligtelser vedrørende genforsikring). |
| C0010-C0020/ R0280 | Skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem skadesforsikring undtagen sygeforsikring og sygeforsikring svarende til skadesforsikring, angives under denne post summen. |
| C0010-C0020/ R0290 | Skadesforsikring undtagen sygeforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikringsvirksomhed, undtagen forsikringsmæssige hensættelser for sygeforsikring svarende til skadesforsikring. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0020/ R0300 | Sygeforsikring svarende til skadesforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til skadesforsikring. |
| C0010-C0020/ R0310 | Livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring og sygeforsikring svarende til livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem livsforsikring undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked og sygeforsikring svarende til livsforsikring, angives under denne post summen. |
| C0010-C0020/ R0320 | Sygeforsikring svarende til livsforsikring | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til livsforsikring. |
| C0010-C0020/ R0330 | Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring, undtagen forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring svarende til livsforsikring og forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksregulerede og unit-linked aftaler. |
| C0010-C0020/ R0340 | Livsforsikring, indeksregulerede og unit-linked aftaler | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler med hensyn til forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked livsforsikringsvirksomhed. |
| C0010-C0020/ R0350 | Indskud til cedenter | Indskud vedrørende accepteret genforsikring. |
| C0010-C0020/ R0360 | Tilgodehavender fra forsikringer og mæglere | Beløb, som skal betales af forsikringstagere og forsikringssselskaber og andre, og som er forbundet med forsikringsvirksomhed, der ikke er medregnet i de forsikringsmæssige hensættelser. Heri medregnes tilgodehavender fra accepteret genforsikring. |
| C0010-C0020/ R0370 | Tilgodehavender fra genforsikring | For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal denne celle indeholde alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genforsikringssselskaber —i tilknytning til genforsikringsvirksomhed — til selskabet, og som ikke er medregnet i beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Disse betalinger bør ikke indgå i posten »alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds« Denne celle bør især indeholde alle forventede betalinger fra genforsikringssselskaber til selskabet svarende til betalinger, der er foretaget af selskabet til forsikringstagere. Heri bør også indgå alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genforsikringssselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder eller begivenheder, som cedenten og genforsikringssselskabet er blevet enige om, og hvor beløbet for den forventede betaling er sikkert. |
| C0010-C0020/ R0380 | Tilgodehavender (handel, ikke forsikring) | Heri medregnes tilgodehavender fra ansatte eller handelspartnere (ikke forsikringsrelateret), herunder offentlige enheder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0020/ R0390 | Egne aktier (som besiddes direkte) | Det samlede beløb for egne aktier, som besiddes direkte af koncernen. |
| C0010-C0020/ R0400 | Forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garantikapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt | Værdien af det forfaldne beløb vedrørende kapitalgrundlagselementer eller garantikapital, der er indkaldt, men endnu ikke indbetalt. |
| C0010-C0020/ R0410 | Likvider | Pengesedler og mønter i omløb, som normalt anvendes til betalinger, og indskud, der på anfordring kan konverteres til kontanter til pari, og som er direkte anvendelige til at foretage betalinger ved check, anvisning, girokort, direkte debitering/kreditering eller lignende direkte betalingsfacilitet uden sanktioner eller begrænsninger. Bankkonti må ikke modregnes; derfor indregnes kun positive konti under denne post, og kassekreditter skal anføres under forpligtelser, medmindre der er både en juridisk ret til modregning og en påviselig hensigt om at nettoafregne. |
| C0010-C0020/ R0420 | Alle øvrige aktiver, ikke anført andetsteds | Alle øvrige aktiver, der ikke allerede er anført andetsteds under balanceførte poster. |
| C0010-C0020/ R0500 | Aktiver i alt | Det samlede beløb for alle aktiver. |
| <i>Passiver</i> | | |
| C0010-C0020/ R0510 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring | Summen af de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring. Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. Hvis det med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er muligt at foretage en opdeling af forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikring mellem skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) og sygeforsikring svarende til skadesforsikring, angives under denne post summen. |
| C0010-C0020/ R0520 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) | De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring). Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0010/R0530 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (eksklusive sygeforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (eksklusive sygeforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0540 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0550 | Forsikringsmæssige hensættelser — skadesforsikring (undtagen sygeforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår skadesforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010-C0020/R0560 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikring (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0570 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0580 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0010/R0590 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til skadesforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin vedrørende forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til skadesforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010-C0020/R0600 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | <p>Summen af de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> <p>Hvis det med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er muligt at foretage en opdeling af forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikring (undtagen indeksreguleret og unit-linked) mellem sygeforsikring (svarende til livsforsikring) og livsforsikring (undtagen sygeforsikring, indeksreguleret og unit-linked), angives under denne post summen.</p> |
| C0010-C0020/R0610 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0620 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0630 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over de forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0640 | Forsikringsmæssige hensættelser — sygeforsikring (svarende til livsforsikring) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår sygeforsikringsvirksomhed (svarende til livsforsikring).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0020/ R0650 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler) | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0660 | Forsikringsmæssige hensættelser — Livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) — Forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (eksklusive sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0670 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksreguleret og unit-linked) — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0680 | Forsikringsmæssige hensættelser — livsforsikring (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler) — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår livsforsikringsvirksomhed (undtagen sygeforsikring og indeksregulerede og unit-linked aftaler).</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010-C0020/ R0690 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked | <p>De samlede forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0700 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et | <p>De forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et (replikerbar/afdækningsbar portefølje) for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|---|
| C0010/R0710 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — Bedste skøn | <p>Det samlede bedste skøn over forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed.</p> <p>Det bedste skøn indberettes uden fradrag af genforsikring.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0010/R0720 | Forsikringsmæssige hensættelser — indeksreguleret og unit-linked — Risikomargin | <p>Den samlede risikomargin for forsikringsmæssige hensættelser for så vidt angår indeksreguleret og unit-linked virksomhed.</p> <p>Heri medregnes fordelingen fra overgangsfradraget vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser i overensstemmelse med den bidragsbaserede metode, der anvendes med henblik på beregningen af minimumskapitalkravet.</p> |
| C0020/R0730 | Andre forsikringsmæssige hensættelser | Andre forsikringsmæssige hensættelser, som indregnet af koncernen i dens lovpligtige regnskaber, i overensstemmelse med lokale GAAP eller IFRS. |
| C0010/R0740 | Eventualforpligtelser | <p>En eventualforpligtelse defineres som:</p> <p>a) en mulig forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, hvis eksistens kun kan bekræftes ved, at der indtræffer eller ikke indtræffer en eller flere usikre fremtidige begivenheder, som ikke er under virksomhedens fulde kontrol, eller</p> <p>b) en aktuel forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, selv hvis:</p> <p>i) det ikke er sandsynligt, at indfrielse af forpligtelsen vil kræve et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer, eller</p> <p>ii) forpligtelsens størrelse ikke kan måles med tilstrækkelig pålidelighed.</p> <p>Eventualforpligtelser, der indregnes i balancen, skal opfylde kriterierne i artikel 11 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> |
| C0010-C0020/R0750 | Hensættelser, som ikke er forsikringsmæssige hensættelser | <p>Forpligtelser, hvis indfrielsestidspunkt eller størrelse er usikker, undtagen forpligtelser indberettet under »Pensionsforpligtelse«.</p> <p>Hensættelserne indregnes som forpligtelser (under forudsætning af at et pålideligt skøn kan foretages), når de repræsenterer forpligtelser, og det er sandsynligt at indfrielse af forpligtelserne vil medføre et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer.</p> |
| C0010-C0020/R0760 | Pensionsforpligtelser | De samlede nettoforpligtelser relateret til medarbejdernes pensionsordning. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0020/ R0770 | Indskud fra genforsikringselskaber | Beløb (f.eks. kontanter) modtaget fra genforsikringsselskaber eller fratrukket af genforsikringsselskaber i henhold til genforsikringsaftalen. |
| C0010-C0020/ R0780 | Udskudte skatteforpligtelser | Udskudte skatteforpligtelser er indkomstskatter, der i fremtidige regnskabsår vil blive betalbare som følge af skattepligtige midlertidige forskelle. |
| C0010-C0020/ R0790 | Derivater | <p>Et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:</p> <p>a) Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikkefinansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).</p> <p>b) Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.</p> <p>c) Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.</p> <p>Kun derivatforpligtelser indberettes i denne række (dvs. derivater med negative værdier på indberetningsdatoen). Derivataktiver offentliggøres under C0010 — C0020/R0190.</p> <p>Koncerner, der ikke værdiansætter derivater i deres lokale GAAP, behøver ikke anføre en regnskabsmæssig værdi.</p> |
| C0010-C0020/ R0800 | Gæld til kreditinstitutter | Gæld, f.eks. realkreditlån og andre lån, til kreditinstitutter, undtagen obligationer, der besiddes af kreditinstitutter (da det er ikke muligt for koncernen at angive alle indehavere af de obligationer, der udstedes) og efterstillet gæld. Kassekreditter medregnes. |
| C0010-C0020/ R0810 | Andre finansielle forpligtelser end gæld til kreditinstitutter | <p>Finansielle forpligtelser, herunder obligationer udstedt af koncernen (uanset om de besiddes af kreditinstitutter eller ej), strukturerede værdipapirer udstedt af koncernen selv og lån, herunder realkreditlån, til andre enheder end kreditinstitutter.</p> <p>Efterstillet gæld medregnes ikke her.</p> |
| C0010-C0020/ R0820 | Forpligtelser vedrørende forsikringer og mæglere | <p>Forpligtelser, der skal betales til forsikringstagere, forsikringsselskaber og vedrørende anden virksomhed, forbundet med forsikring, men som ikke er medtaget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Heri medregnes forpligtelser over for (gen)forsikringsmæglere (f.eks. mæglerprovisioner, der er forfaldne, men endnu ikke betalt af selskabet).</p> <p>Heri medregnes ikke forfaldne låneforpligtelser, herunder i form af realkreditlån, over for andre forsikringsselskaber, hvis de kun vedrører finansiering og ikke er forbundet med forsikringsvirksomhed (sådanne lån, herunder realkreditlån, skal indberettes som finansielle forpligtelser).</p> <p>Heri medregnes forpligtelser vedrørende accepteret genforsikring.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010-C0020/ R0830 | Forpligtelser vedrørende genforsikring | <p>Andre forpligtelser over for genforsikringselskaber (især anfordringskonti) end indskud forbundet med genforsikringsvirksomhed, der ikke er medtaget i beløb, der kan tilbagekræves, herunder forpligtelser fra selskabet over for genforsikringselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder.</p> <p>Heri medregnes forpligtelser over for genforsikringselskaber vedrørende cederede præmier.</p> <p>For kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal denne celle indeholde alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra selskabet til genforsikringselskaber, som ikke er medregnet i beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Disse betalinger bør ikke indgå i posten »alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds«</p> <p>Denne celle bør især indeholde alle forventede betalinger fra selskabet til genforsikringselskaber, som svarer til betalinger, der er foretaget af forsikringstagere til selskabet.</p> <p>Heri bør også indgå alle forventede betalinger (skyldige og forfaldne) fra genforsikringselskaber i tilknytning til andre begivenheder end forsikringsbegivenheder eller begivenheder, som cedenten og genforsikringselskabet er blevet enige om, og hvor beløbet for den forventede betaling er sikkert.</p> |
| C0010-C0020/ R0840 | Forpligtelser (handel, ikke forsikring) | <p>Handelsforpligtelser i alt, herunder beløb til ansatte, leverandører osv., som ikke er forbundet med forsikring, parallelt med tilgodehavender (handel, ikke forsikring) på aktivsiden; omfatter også offentlige enheder.</p> |
| C0010-C0020/ R0850 | Efterstillet gæld | <p>Efterstillet gæld er gæld, der er efterstillet anden specificeret gæld, når selskabet likvideres. Efterstillet gæld, der er klassificeret som basiskapitalgrundlag, og efterstillet gæld, der ikke er medregnet i basiskapitalgrundlaget, i alt.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlag og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, angives under denne post summen.</p> |
| C0010-C0020/ R0860 | Efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget | <p>Efterstillet gæld er gæld, der er efterstillet anden specificeret gæld, når selskabet likvideres. Anden gæld kan være endnu mere efterstillet. Kun efterstillet gæld, der ikke er klassificeret som basiskapitalgrundlag, anføres her.</p> <p>Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i basiskapitalgrundlaget og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, indberettes denne post ikke.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0010-C0020/ R0870 | Efterstillet gæld medregnet i basiskapitalgrundlaget | Efterstillet gæld klassificeret som basiskapitalgrundlag. Hvis der med henblik på udfyldelse af kolonnen »Regnskabsmæssig værdi« (C0020) ikke er en opdeling mellem efterstillet gæld ikke medregnet i kapitalgrundlaget og efterstillet gæld medregnet i kapitalgrundlaget, indberettes denne post ikke. |
| C0010-C0020/ R0880 | Alle øvrige passiver, ikke anført andetsteds | Alle øvrige passiver, der ikke allerede er anført andetsteds under balanceførte poster. |
| C0010-C0020/ R0900 | Passiver i alt | Alle passiver i alt. |
| C0010/R1000 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Koncernens samlede overskydende aktiver i forhold til passiver som værdiansat i henhold til Solvens II-værdiansættelsesgrundlaget. Værdi af aktiver minus passiver. |
| C0020/R1000 | Overskydende aktiver i forhold til passiver (regnskabsmæssig værdi) | Den samlede værdi i »Overskydende aktiver i forhold til passiver« i kolonnen »Regnskabsmæssig værdi«. |

S.02.02 — Passiver efter valuta

Generel bemærkning:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema skal udfyldes i overensstemmelse med balancen (S.02.01). Der er fastsat værdiansættelsesprincipper i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder og retningslinjer vedrørende Solvens II.

Dette skema skal ikke indgives, hvis én enkelt valuta tegner sig for mere end 80 % af passiverne. Hvis værdien af de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0030 og R0120 i S.12.01 og R0060 og R0160 i S.17.01, er negativ, skal disse notionelle værdier i forbindelse med beregningen af tærskelen over den absolutte værdi tages i betragtning uden fradrag af de forsikringsmæssige hensættelser mellem de forskellige brancher.

Hvis det indgives, skal der altid indberettes oplysninger om indberetningsvalutaen, uanset beløbet for passiver. Oplysninger indberettet efter valuta skal som minimum tegne sig for 80 % af de samlede passiver. De resterende 20 % lægges sammen. Hvis en bestemt valuta skal anvendes i indberetningen af passiver til opfyldelse af bestemmelsen om 80 %, anvendes denne valuta i indberetningen af alle passiver.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0010 | Væsentlig valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for hver valuta, som indberettes. |
| C0020/R0110 | Samlet værdi for alle valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet det samlede beløb for de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for alle valutaer. |
| C0030/R0110 | Værdi for indberetningsvalutaen — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0110 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet det samlede beløb for forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0110) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0110). |
| C0050/R0110 | Værdi for væsentlige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser (undtagen indeksregulerede og unit-linked aftaler) for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0120 | Samlet værdi for alle valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser (indeksregulerede og unit-linked aftaler) | Indberet det samlede beløb for de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for alle valutaer. |
| C0030/R0120 | Værdi for indberetningsvalutaen — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0120 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0120) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0120). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0050/R0120 | Værdi for væsentlige valutaer — Forsikringsmæssige hensættelser — Indeksregulerede og unit-linked aftaler | Indberet værdien af de forsikringsmæssige hensættelser — indeksregulerede og unit-linked aftaler for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0130 | Samlet værdi for alle valutaer — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet det samlede beløb for indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for alle valutaer. |
| C0030/R0130 | Værdi for indberetningsvalutaen — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0130 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0130) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0130). |
| C0050/R0130 | Værdi for væsentlige valutaer — Indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring | Indberet værdien af indskud fra genforsikringsselskaber og forpligtelser vedrørende forsikring, mæglere og genforsikring for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0140 | Samlet værdi for alle valutaer — Derivater | Indberet det samlede beløb for derivaterne for alle valutaer. |
| C0030/R0140 | Værdi for indberetningsvalutaen — Derivater | Indberet værdien af derivaterne for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0140 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Derivater | Indberet det samlede beløb for derivater for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0140) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0140). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0050/R0140 | Værdi for væsentlige valutaer — Derivater | Indberet værdien af derivaterne for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0150 | Samlet værdi for alle valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet det samlede beløb for de finansielle forpligtelser for alle valutaer. |
| C0030/R0150 | Værdi for indberetningsvalutaen — Finansielle forpligtelser | Indberet værdien af de finansielle forpligtelser for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0150 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet det samlede beløb for de finansielle forpligtelser for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0150) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0150). |
| C0050/R0150 | Værdi for væsentlige valutaer — Finansielle forpligtelser | Indberet værdien af de finansielle forpligtelser for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0160 | Samlet værdi for alle valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet det samlede beløb for eventualforpligtelserne for alle valutaer. |
| C0030/R0160 | Værdi for indberetningsvalutaen — Eventualforpligtelser | Indberet værdien af eventualforpligtelserne for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0160 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet det samlede beløb for eventualforpligtelserne for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0160) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0160). |
| C0050/R0160 | Værdi for væsentlige valutaer — Eventualforpligtelser | Indberet værdien af eventualforpligtelserne for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0170 | Samlet værdi for alle valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet det samlede beløb for alle øvrige passiver for alle valutaer. |
| C0030/R0170 | Værdi for indberetningsvalutaen — Alle øvrige passiver | Indberet værdien af alle øvrige passiver for indberetningsvalutaen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0040/R0170 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet det samlede beløb for alle øvrige passiver for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0170) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0170). |
| C0050/R0170 | Værdi for væsentlige valutaer — Alle øvrige passiver | Indberet værdien af alle øvrige passiver for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |
| C0020/R0200 | Samlet værdi for alle valutaer — Samlede passiver | Indberet det samlede beløb for de samlede passiver for alle valutaer. |
| C0030/R0200 | Værdi for indberetningsvalutaen — Samlede passiver | Indberet værdien af de samlede passiver for indberetningsvalutaen. |
| C0040/R0200 | Værdi for resterende øvrige valutaer — Samlede passiver | Indberet det samlede beløb for de samlede passiver for de resterende valutaer, der ikke indberettes efter valuta. Det betyder, at denne celle ikke omfatter den værdi, der er indberettet i indberetningsvalutaen (C0030/R0200) og i valutaerne indberettet efter valuta (C0050/R0200). |
| C0050/R0200 | Værdi for væsentlige valutaer — Samlede passiver | Indberet værdien af de samlede passiver for hver af de valutaer, der skal indberettes særskilt. |

S.03.01 — Ikkebalanceførte poster — Generelt

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema skal indeholde oplysningerne om ikkebalanceførte poster samt den maksimale værdi og Solvens II-værdien af eventalforpligtelser på Solvens II-balancen. Hvad angår Solvens II-værdien defineres posterne i vejledningen ud fra en indregningstilgang. Der er fastsat værdiansættelsesprincipper i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder og retningslinjer vedrørende Solvens II.

En aktiepulje, som sikrer en investering (f.eks. den aktiepulje, der er sikkerhed for dækkede obligationer), indberettes ikke i dette skema.

Garantier kræver, at udsteder betaler bestemte beløb som godtgørelse til indehaver for et tab, som denne pådrager sig, hvis en bestemt debitor ikke foretager rettidig betaling i henhold til de oprindelige eller ændrede vilkår for et gældsinstrument. Disse garantier kan antage forskellige juridiske former, såsom finansielle garantier, rembuser og kreditmisligholdelskontrakter. I disse poster medregnes ikke garantier hidrørende fra forsikringsaftaler, som er indregnet i forsikringsmæssige hensættelser.

En eventualforpligtelse defineres som:

- a) en mulig forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, hvis eksistens kun kan bekræftes ved, at der indtræffer eller ikke indtræffer en eller flere usikre fremtidige begivenheder, som ikke er under virksomhedens fulde kontrol, eller
- b) en aktuel forpligtelse, der hidrører fra tidligere begivenheder, selv hvis:
 - i. det ikke er sandsynligt, at indfrielse af forpligtelsen vil kræve et træk på virksomhedens økonomiske ressourcer, eller
 - ii. forpligtelsens størrelse ikke kan måles med tilstrækkelig pålidelighed.

Sikkerhedsstillelse er et aktiv med en monetær værdi eller en forpligtelse, der sikrer långiveren, i tilfælde af at låntageren misligholder sin forpligtelse. Værdien af denne sikkerhed skal indberettes som økonomisk værdi for sikkerheden pr. referencedato (Solvens II-værdi for aktiverne), og ikke som den risikojusterede værdi af en sikkerhed i henhold til den delegerede forordnings artikel 197.

Kun begrænsede garantier skal indberettes i dette skema. Interne garantier, der er omfattet af koncerntilsynet, indberettes ikke i dette skema, eksklusivt oplysninger om stillede eller modtagne ubegrænsede garantier.

På koncernniveau anvendes skemaer for alle enheder, der er omfattet af koncerntilsynet — herunder andre finansielle sektorer og kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber — for metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

For kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber medregnes stillede garantier og modtagne garantier forholdsmæssigt, når metode 1 anvendes. Når metode 2 anvendes, indberettes den samlede værdi for garantierne.

Dette skema indgives under hensyntagen til følgende specifikationer, som vedrører vejledningen i nedenstående tabel:

- a) beløbet for enhver af de følgende sammenlægninger overstiger 2 % af de samlede aktiver:
 - i. (C0020/R0010) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af selskabet, herunder remburser + (C0020/R0300) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed + (C0010/R0400) Maksimalværdi — Eventualforpligtelser i alt
 - ii. (C0020/R0030) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier modtaget af selskabet, herunder remburser + (C0020/R0200) Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet sikkerhed, der besiddes, eller
- b) selskabet har givet eller modtaget en ubegrænset garanti.

Selskaber, der er konsolideret i overensstemmelse med artikel 335, stk. 1, litra d), e), og f), i delegeret forordning (EU) 2015/35), kan ikke indgå i beregningen af tærsklen.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0010 | Maksimal værdi — Garantier stillet af koncernen, herunder remburs | Summen af hele det mulige likviditetstab forbundet med garantier, hvis de hændelser, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier stillet af koncernen til en anden part. Heri medregnes cash flow i forbindelse med remburs. Hvis en garanti også angives som eventualforpligtelse under R0310, medregnes den maksimale værdi også i denne række. |
| C0020/R0010 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier stillet af koncernen, herunder remburs | Solvens II-værdi af de garantier, der er stillet af koncernen, herunder remburs. |
| C0010/R0030 | Maksimal værdi — Garantier modtaget af koncernen, herunder remburs | Summen af hele den mulige likviditetstilførsel forbundet med garantier, hvis de hændelser, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier modtaget af koncernen fra en anden part for at garantere betaling af koncernens forpligtelser (heri medregnes remburs, uudnyttede lånefaciliteter). |
| C0020/R0030 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Garantier modtaget af koncernen, herunder remburs | Solvens II-værdi af de garantier, der er modtaget af koncernen, herunder remburs. |
| C0020/R0100 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0110 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed, der besiddes for derivater | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for derivater. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0120 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser | Solvens II-værdi af aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0020/R0130 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Anden sikkerhed, der besiddes | Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes for derivater. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0200 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet sikkerhed, der besiddes | Samlet Solvens II-værdi af sikkerhed, der besiddes. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0030/R0100 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Sikkerhed, der besiddes for ydede lån eller købte obligationer | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed for ydede lån eller købte obligationer. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0030/R0110 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Sikkerhed, der besiddes for derivater | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed for derivater. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0030/R0120 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser | Solvens II-værdi af de aktiver, der er stillet som sikkerhed af genforsikringsselskaber for cederede forsikringsmæssige hensættelser. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0030/R0130 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Anden sikkerhed, der besiddes | Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke der besiddes anden sikkerhed. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0030/R0200 | Værdi af aktiver, for hvilke der besiddes sikkerhed — Samlet sikkerhed, der besiddes | Samlet Solvens II-værdi af de aktiver, for hvilke den samlede sikkerhed besiddes. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0210 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer | Solvens II-værdi af den sikkerhed, der er stillet for modtagne lån eller udstedte obligationer. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0020/R0220 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Sikkerhed stillet for derivater | Solvens II-værdi af sikkerhed stillet for derivater. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0230 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Aktiver stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring) | Solvens II-værdi af de aktiver, der er stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0240 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Anden stillet sikkerhed | Solvens II-værdi af sikkerhed stillet for anden sikkerhedsstillelse. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0020/R0300 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Samlet stillet sikkerhed | Samlet Solvens II-værdi af den stillede sikkerhed. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0040/R0210 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Stillet sikkerhed for modtagne lån eller udstedte obligationer | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed for modtagne lån eller udstedte obligationer. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0040/R0220 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Sikkerhed stillet for derivater | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed for derivater. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0040/R0230 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Aktiver stillet som sikkerhed over for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring) | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke aktiverne er stillet som sikkerhed for cedenter for forsikringsmæssige hensættelser (accepteret genforsikring). Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sectorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0040/R0240 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Anden stillet sikkerhed | Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke der er stillet anden sikkerhed. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sektorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0040/R0300 | Værdi af passiver, for hvilke der er stillet sikkerhed — Samlet stillet sikkerhed | Samlet Solvens II-værdi af de passiver, for hvilke sikkerheden er stillet. Det kan i dette tilfælde være relevant at anvende lokale/sektorbestemte værdiansættelsesprincipper frem for Solvens II-reglerne. |
| C0010/R0310 | Maksimal værdi — Eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen | Størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidigt likviditetstab, der er nødvendigt for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der ikke er omfattet af de på Solvens II-balancen værdiansatte eventualforpligtelser (post C0010/R0740 i S.02.01). Interne eventualforpligtelser, der er omfattet af koncerntilsynet, indberettes i dette skema. Dette vedrører eventualforpligtelser, der ikke er væsentlige. I værdien skal medregnes garantier indberettet under R0010, hvis de regnes for eventualforpligtelser. |
| C0010/R0330 | Maksimal værdi — Eventualforpligtelser på Solvens II-balancen | Størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidigt likviditetstab, der er nødvendigt for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der er indregnet i Solvens II-balancen, som fastsat i artikel 11 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0010/R0400 | Maksimal værdi — Samlede eventualforpligtelser | Samlede størst mulige værdi, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidige cash flow, der er nødvendige for at honorere eventualforpligtelsen frem til udløb, diskonteret ved den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser. |
| C0020/R0310 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Eventualforpligtelser ikke på Solvens II-balancen | Solvens II-værdi af de eventualforpligtelser, der ikke er opført på Solvens II-balancen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0020/R0330 | Værdi af garanti/sikkerhedsstillelse/eventualforpligtelser — Eventualforpligtelser på Solvens II-balancen | Solvens II-værdi af eventualforpligtelserne på Solvens II-balancen. Denne værdi indberettes kun i forbindelse med eventualforpligtelser, for hvilke der er indberettet en værdi under post C0010/R0330 i S.03.01. Hvis denne værdi er lavere end C0010/R0740 i S.02.01, skal der gives en forklaring i den beskrivende del af indberetningen. |
| C0050/R0510 | Ubegrænsede garantier — modtaget | Angiv, om de modtagne ubegrænsede garantier findes. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 0 — Ingen modtagne ubegrænsede garantier 1 — Ubegrænsede garantier, kun modtaget fra koncernen 2 — Ubegrænsede garantier, kun modtaget uden for koncernen 3 — Ubegrænsede garantier, modtaget både fra koncernen og uden for koncernen. |
| C0050/R0520 | Ubegrænsede garantier — stillet | Angiv, om de stillede ubegrænsede garantier findes. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 0 — Ingen stillede ubegrænsede garantier 1 — Ubegrænsede garantier, kun stillet af koncernen 2 — Ubegrænsede garantier, kun stillet uden for koncernen 3 — Ubegrænsede garantier, stillet både af koncernen og uden for koncernen. |

S.05.01 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter branche

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema skal indberettes ud fra en konsolideret regnskabsmæssig tilgang, dvs. lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP, men under anvendelse af Solvens II-brancher. Selskaber skal anvende samme værdiansættelses- og indregningsgrundlag som for de offentliggjorte regnskaber; der kræves ingen ny indregning eller værdiansættelse, medmindre andet er anført i denne vejledning, med undtagelse af klassificeringen mellem investeringsaftaler og forsikringsaftaler eller forskellige indberetningskrav, når dette anvendes i regnskabet. I dette skema indgår al forsikringsvirksomhed, uanset om der anvendes en eventuel forskellig klassificering af investeringsaftaler og forsikringsaftaler i regnskabet.

Tegnede præmier/præmieindtægter offentliggøres som defineret i artikel 1, nr. 11) og 12), i delegeret forordning (EU) 2015/35, uanset om der er anvendt lokal GAAP eller IFRS.

Skemaet er baseret på et år-til-dato-grundlag.

Dette skema vedrører kun forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, der er omfattet af koncernregnskabet.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser

| | | |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0120/ R0110 | Tegnede præmier — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0120/ R0120 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0130-C0160/ R0130 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0140 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikringselskaber, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0200 | Tegnede præmier — Netto | De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0010-C0120/ R0210 | Præmieindtægter — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i indtægterne for de tegnede præmier. |
| C0010-C0120/ R0220 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i præmieindtægterne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0130-C0160/ R0230 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genfor- sikring | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i indtægterne for de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0240 | Præmieindtægter — Genforsikringsandel | Summen af genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen af præmiehensættelser. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i indtægterne for de tegnede præmier. |
| C0010-C0160/ R0300 | Præmieindtægter — Netto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0010-C0120/ R0310 | Erstatningsudgifter — Brutto — Direkte forsik- ringsvirksomhed | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) i indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010-C0120/ R0320 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret proportional genforsik- ring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) i indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0130-C0160/ R0330 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genfor- sikring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) i indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0010-C0160/ R0340 | Erstatningsudgifter — Genforsikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: genforsikringsandelen af summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) i indberetningsperioden. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0160/ R0400 | Erstatningsudgifter — Netto | <p>Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) i indberetningsperioden i tilknytning til summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> <p>Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0550 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som koncernen har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |
| C0010-C0120/ R0610 | Administrationsomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0120/ R0620 | Administrationsomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0130-C0160/ R0630 | Administrationsomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0160/ R0640 | Administrationsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genikrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0700 | Administrationsomkostninger — Netto | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genikrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |
| C0010-C0160/ R0710 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0120/ R0720 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0130-C0160/ R0730 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0160/ R0740 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Genforsikringsandel | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0800 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Netto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører nettoudgifterne til forvaltning af investeringer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne ved investering summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |
| C0010-C0120/ R0810 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0120/ R0820 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0130-C0160/ R0830 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0840 | Skadesbehandlingsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R0900 | Skadesbehandlingsomkostninger — Netto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Nettoskadesbehandlingsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0010-C0120/ R0910 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0120/ R0920 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0130-C0160/ R0930 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto.</p> |
| C0010-C0160/ R0940 | Anskaffelsesomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0010-C0160/ R1000 | Anskaffelsesomkostninger — Netto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, herunder fornyelsesomkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringsselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Nettoanskaffelsesomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0010-C0120/ R1010 | Overheadomkostninger — Direkte forsikrings- virksomhed, opgjort brutto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto. |
| C0010-C0120/ R1020 | Overheadomkostninger — Brutto — Accepteret proportional genforsik- ring | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører accepteret proportional genforsikring, opgjort brutto. |
| C0130-C0160/ R1030 | Overheadomkostninger — Brutto — Accepteret ikkeproportional genfor- sikring | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører accepteret ikkeproportional genforsikring, opgjort brutto. |
| C0010-C0160/ R1040 | Overheadomkostninger — Genforsikringsandel | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører genforsikringsandelen. Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0010-C0160/ R1100 | Overheadomkostninger — Netto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Nettogeneralomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikrings-selskaber. |
| C0200/R0110– R1100 | I alt | I alt for forskellige poster for alle brancher. |
| C0200/R1210 | Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter, der ikke er omfattet af ovennævnte omkostninger/indtægter, og som er reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikrings-selskaber. Andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter opdeles ikke efter branche. Heri bør ikke medregnes ændring i andre forsikringsmæssige hensættelser og ikkeforsikringsmæssige omkostninger/indtægter, som f.eks. skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter skal indberettes som en negativ værdi, hvis de forsikringsmæssige indtægter overstiger de forsikringsmæssige omkostninger. |
| C0200/R1300 | Samlede omkostninger | Forsikringsmæssige omkostninger i alt. |

Livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser

| | | |
|-----------------------|--|--|
| C0210-C0280/ R1410 | Tegnede præmier — Brutto | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. Heri medregnes både direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomhed. |
| C0210-C0280/ R1420 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikrings-selskaber og forfaldet, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0210-C0280/ R1500 | Tegnede præmier — Netto | De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikrings-selskaber. |
| C0210-C0280/ R1510 | Præmieindtægter — Brutto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |
| C0210-C0280/ R1520 | Præmieindtægter — Genforsikringsandel | Genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen i præmiehensættelser. Beløb for skatter og gebyrer opkrævet sammen med præmier medtages ikke i de tegnede præmier. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0210-C0280/ R1600 | Præmieindtægter — Netto | Summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0210-C0280/ R1610 | Erstatningsudgifter — Brutto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1620 | Erstatningsudgifter — Genforsikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som omhandlet i direktiv 91/674/EØF: Genforsikringsandelen i summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1700 | Erstatningsudgifter — Netto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som omhandlet i direktiv 91/674/EØF: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden (i overensstemmelse med den lokale GAAP eller den anvendte IFRS-standard) for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0210-C0280/ R1900 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som koncernen har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |
| C0210-C0280/ R1910 | Administrationsomkostninger — Brutto | Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genkrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer. Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0210-C0280/ R1920 | Administrationsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genikrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2000 | Administrationsomkostninger — Netto | <p>Administrationsomkostninger, som koncernen pådrager sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet, er omkostninger, der er forbundet med administration af policer, herunder omkostninger vedrørende genforsikringsaftaler og SPV'er. Nogle administrationsomkostninger er direkte forbundet med aktivitet vedrørende en specifik forsikringsaftale (f.eks. vedligeholdelsesomkostninger), såsom omkostninger ved fakturering af præmier, omkostninger ved regelmæssigt at sende oplysninger til forsikringstagere og omkostninger ved policeændringer (f.eks. konverteringer og genikrafttrædelser). Andre administrationsomkostninger er direkte forbundet med forsikringsaktivitet, men er resultatet af aktiviteter, der dækker mere end én police, såsom løn til ansatte med ansvar for administration af policer.</p> <p>Beløbet vedrører nettoadministrationsomkostningerne.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2010 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Brutto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |
| C0210-C0280/ R2020 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Genforsikringsandel | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| | | <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2100 | Udgifter til forvaltning af investeringer — Netto | <p>Udgifter til forvaltning af investeringer allokeres som regel ikke til de enkelte policer, men til en portefølje af forsikringsaftaler. Udgifter til forvaltning af investeringer kan omfatte udgifter til opbevaring af oplysninger om investeringsporteføljen, løn til ansatte med ansvar for investering, aflønning af eksterne rådgivere, udgifter forbundet med handel med investeringer (dvs. køb og salg af porteføljepapirerne) og i nogle tilfælde også aflønning for depotydelse.</p> <p>Beløbet vedrører nettoudgifterne til forvaltning af investeringer.</p> <p>Nettoadministrationsomkostningerne ved investering summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2110 | Skadesbehandlingsomkostninger — Brutto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2120 | Skadesbehandlingsomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2200 | Skadesbehandlingsomkostninger — Netto | <p>Skadesbehandlingsomkostninger er omkostninger, der påløber i forbindelse med behandling og løsning af krav, herunder advokatsalærer og taksatorhonorarer og interne omkostninger i forbindelse med behandling af krav. Nogle af disse omkostninger kan tilskrives individuelle krav (f.eks. advokatsalærer og taksatorhonorarer), andre skyldes aktiviteter, der vedrører mere end ét krav (f.eks. løn til ansatte i skadesbehandlingsafdelingen).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| | | <p>Nettoskadesbehandlingsomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> <p>Heri medregnes bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2210 | Anskaffelsesomkostninger — Brutto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |
| C0210-C0280/ R2220 | Anskaffelsesomkostninger — Genforsikringsandel | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Beløbet vedrører genforsikringsandelen.</p> <p>Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger.</p> |
| C0210-C0280/ R2300 | Anskaffelsesomkostninger — Netto | <p>Anskaffelsesomkostninger omfatter omkostninger, der kan identificeres for den enkelte forsikringsaftale, og som er opstået, fordi selskabet har udstedt den pågældende aftale. Disse omfatter provisionsomkostninger samt omkostninger ved at sælge, indgå og iværksætte en forsikringsaftale, der er udstedt. Heri medregnes bevægelser i udskudte anskaffelsesomkostninger. For genforsikringselskabers vedkommende anvendes definitionen med de fornødne ændringer.</p> <p>Nettoanskaffelsesomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber.</p> |
| C0210-C0280/ R2310 | Overheadomkostninger — Brutto | <p>Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software).</p> <p>Beløbet vedrører den direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomheden, opgjort brutto.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| C0210-C0280/ R2320 | Overheadomkostninger — Genforsikringsandel | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Beløbet vedrører genforsikringsandelen. Genforsikringsandelen opdeles som standard efter omkostningstype; hvis det ikke er muligt, indberettes den som anskaffelsesomkostninger. |
| C0210-C0280/ R2400 | Overheadomkostninger — Netto | Overheadomkostninger omfatter løn til direktører, revisionsomkostninger og regelmæssige daglige udgifter, f.eks. elregninger, leje af bygninger, IT-udgifter. Disse overheadomkostninger omfatter også udgifter forbundet med udviklingen af ny forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, markedsføring af forsikringsprodukter, forbedringer af de interne processer såsom investering i systemer, der er nødvendige for at understøtte forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (f.eks. køb af nyt IT-system og udvikling af ny software). Nettogeneralomkostningerne summeres for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed og reduceres med det beløb, der er cederet til genforsikrings-selskaber. |
| C0300/R1410– R2400 | I alt | I alt for forskellige poster for alle brancher. |
| C0300/R2510 | Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter, der ikke er omfattet af ovennævnte omkostninger/indtægter, og som er reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikrings-selskaber. Andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter opdeles ikke efter branche. Heri bør ikke medregnes ændring i andre forsikringsmæssige hensættelser og ikkeforsikringsmæssige omkostninger/indtægter, som f.eks. skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter skal indberettes som en negativ værdi, hvis de forsikringsmæssige indtægter overstiger de forsikringsmæssige omkostninger. |
| C0300/R2600 | Samlede omkostninger | Forsikringsmæssige omkostninger i alt. |
| C0210-C0280/ R2700 | Genkøb i alt | Det samlede beløb for genkøb, der er sket i løbet af året. Beløbet indberettes også under erstatningsudgifter (post R1610). |

S.05.02 — Præmier, erstatningsudgifter og omkostninger efter land

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner. Skemaet udfyldes ikke, når de nedenfor anførte tærskler for indberetning efter land ikke finder anvendelse, dvs. når hjemlandet tegner sig for 90 % eller mere af det samlede beløb for de tegnede bruttopræmier.

Dette skema skal indberettes ud fra en regnskabsmæssig tilgang, dvs. lokale GAAP eller IFRS, hvis disse accepteres som lokale GAAP. Selskaber skal anvende samme værdiansættelses- og indregningsgrundlag som for de offentliggjorte regnskaber; der kræves ingen ny indregning eller værdiansættelse med undtagelse af klassificeringen mellem investeringsaftaler og forsikringsaftaler, når dette anvendes i regnskabet. I dette skema indgår al forsikringsvirksomhed, uanset om der anvendes en eventuel forskellig klassificering af investeringsaftaler og forsikringsaftaler i regnskabet.

Dette skema vedrører kun forsikrings- og genforsikringsvirksomhed, der ikke er omfattet af koncernregnskabet.

Følgende kriterier for klassificering efter land anvendes:

- Oplysningerne, anført efter land, skal angives for de fem lande med den største værdi af tegnede bruttopræmier i tillæg til hjemlandet, eller indtil 90 % af det samlede beløb for de tegnede bruttopræmier er nået:
- Med hensyn til direkte forsikringsvirksomhed for brancherne »Udgifter til lægebehandling«, »Indkomstsikring«, »Arbejdsskadeforsikring«, »Brand og andre skader på ejendom« og »Kredit- og kauforsikring« skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor risikoen består, som defineret i artikel 13, nr. 13), i direktiv 2009/138/EF.
- Med hensyn til direkte forsikringsvirksomhed for alle andre brancher skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor kontrakten blev indgået.
- Med hensyn til proportional og ikkeproportional genforsikring skal oplysningerne indberettes efter det land, hvor det cederende selskab er beliggende.

I dette skema forstås ved »det land, hvor kontrakten blev indgået«:

- a) det land, hvor forsikrings-selskabet er etableret (hjemland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial eller i henhold til reglerne om den frie udveksling af tjenesteydelser
- b) det land, hvor filialen er beliggende (værtsland), hvis kontrakten ikke blev solgt gennem en filial
- c) det land, hvor retten til fri udveksling af tjenesteydelser blev meddelt (værtsland), hvis kontrakten blev solgt i henhold til den frie udveksling af tjenesteydelser
- d) Hvis der blev anvendt en mægler, eller i enhver anden situation, gælder a), b) eller c), afhængigt af hvem der solgte kontrakten.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| | <i>Skadesforsikrings- og skadesgenforsikringsforpligtelser</i> | |
| C0020-C0060/R0010 | Top 5-lande (efter beløbet for tegnede bruttopræmier) — skadesforsikringsforpligtelser | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for de lande, for hvilke der indberettes skadesforsikringsforpligtelser. |
| C0080-C0140/R0110 | Tegnede præmier — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |
| C0080-C0140/R0120 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret proportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0080-C0140/R0130 | Tegnede præmier — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling for forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |
| C0080-C0140/R0140 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikringselskaber, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |
| C0080-C0140/R0200 | Tegnede præmier — Netto | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0080-C0140/R0210 | Præmieindtægter — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. |
| C0080-C0140/R0220 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for accepteret proportional genforsikringsvirksomhed. |
| C0080-C0140/R0230 | Præmieindtægter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for accepteret ikkeproportional genforsikringsvirksomhed. |
| C0080-C0140/R0240 | Præmieindtægter — Genforsikringsandel | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Summen af genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen af præmiehensættelser. |
| C0080-C0140/R0300 | Præmieindtægter — Netto | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0080-C0140/R0310 | Erstatningsudgifter — Brutto — Direkte forsikringsvirksomhed | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af regnskabsåret vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0080-C0140/R0320 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret proportional genforsikring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret proportional genforsikring. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0080-C0140/R0330 | Erstatningsudgifter — Brutto — Accepteret ikkeproportional genforsikring | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til accepteret ikkeproportional genforsikring. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0080-C0140/R0340 | Erstatningsudgifter — Genforsikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Genforsikringsandelen i summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0080-C0140/R0400 | Erstatningsudgifter — Netto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringsselskaber. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0080-C0140/R0550 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som koncernen har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------------------|--|---|
| C0140/R1210 | Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | Andre forsikringsmæssige omkostninger, der ikke indgår i ovennævnte omkostninger og ikke er opdelt efter branche. Heri medregnes ikke ikkeforsikringsmæssige omkostninger såsom skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. |
| C0140/R1300 | Samlede forsikringsmæssige omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger for lande omfattet af dette skema. |
| <i>Livsforsikringsforpligtelser</i> | | |
| C0160-C0200/R1400 | Top 5-lande (efter beløbet tegnede bruttopræmier) — livsforsikringsforpligtelser | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for de lande, for hvilke der indberettes livsforsikringsforpligtelser. |
| C0220-C0280/R1410 | Tegnede præmier — Brutto | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |
| C0220-C0280/R1420 | Tegnede præmier — Genforsikringsandel | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i indberetningsperioden er cederet til genforsikringselskaber og forfaldet, for forsikringsaftaler, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører en senere indberetningsperiode. |
| C0220-C0280/R1500 | Tegnede præmier — Netto | Tegnede præmier som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: De tegnede nettopræmier udgør summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0220-C0280/R1510 | Præmieindtægter — Brutto | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto. |
| C0220-C0280/R1520 | Præmieindtægter — Genforsikringsandel | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Genforsikringsandelen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i genforsikringsandelen i præmiehensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0220-C0280/R1600 | Præmieindtægter — Netto | Præmieindtægter som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. |
| C0220-C0280/R1610 | Erstatningsudgifter — Brutto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden vedrørende forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed og genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0220-C0280/R1620 | Erstatningsudgifter — Genforsikringsandel | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Genforsikringsandelen i summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0220-C0280/R1700 | Erstatningsudgifter — Netto | Erstatningsudgifter i indberetningsperioden som defineret i direktiv 91/674/EØF, hvor det er relevant: Erstatningsudgifter er summen af udbetalte erstatninger og ændringen i erstatningshensættelser i løbet af indberetningsperioden for summen af direkte forsikringsvirksomhed og accepteret genforsikringsvirksomhed reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. Heri medregnes ikke skadesbehandlingsomkostninger og bevægelser i hensættelser til skadesbehandlingsomkostninger. |
| C0220-C0280/R1900 | Omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger, som koncernen har pådraget sig i løbet af indberetningsperioden, efter periodiseringsprincippet. |
| C0280/R2510 | Balance — andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter | Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter, der ikke er omfattet af ovennævnte omkostninger/indtægter, og som er reduceret med det beløb, der er cederet til genforsikringselskaber. Andre forsikringsmæssige omkostninger/indtægter opdeles ikke efter branche. Heri bør ikke medregnes ændring i andre forsikringsmæssige hensættelser og ikkeforsikringsmæssige omkostninger/indtægter, som f.eks. skat, renteudgifter, tab ved afhændelse osv. Forsikringsmæssige nettoomkostninger/-indtægter skal indberettes som en negativ værdi, hvis de forsikringsmæssige indtægter overstiger de forsikringsmæssige omkostninger. |
| C0280/R2600 | Samlede forsikringsmæssige omkostninger | Alle forsikringsmæssige omkostninger for lande omfattet af dette skema. |

S.06.02 — Liste over aktiver

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Dette skema skal afspejle listen over alle aktiver i balancen, der kan klassificeres i aktivkategori 0-9 i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning. Især i tilfælde af aftaler om værdipapirudlån og -genkøb skal de underliggende værdipapirer, der beholdes i balancen, indberettes i dette skema.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over aktiver, der besiddes direkte af koncernen (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), og som kan klassificeres som aktivkategori 0-9 (i tilfælde af unit-linked og indeksregulerede produkter, der forvaltes af (gen)forsikringselskabet, er de aktiver, der skal indberettes, også kun dem, som er omfattet af aktivkategori 0-9; f.eks. skal beløb, der kan tilbagekræves, og forpligtelser forbundet med disse produkter ikke indberettes), med følgende undtagelser:

- a) Kontanter skal indberettes i én række pr. valuta, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.
- b) Konverterbare indskud (likvider) og andre indskud med en løbetid på under et år skal indberettes i én række pr. bank og valuta, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290.
- c) Lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, herunder policelån, skal indberettes i to rækker, én række vedrørende lån til administrations-, ledelses- og tilsynsorganer, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290 og en anden række vedrørende lån til andre fysiske personer, for hver kombination af post C0060, C0070, C0080, C0090 og C0290.
- d) Indskud til cedenter skal indberettes i én række for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.
- e) Materielle anlægsaktiver til selskabets eget brug skal indberettes i én række for hver kombination af post C0060, C0070, C0080 og C0090.

Alle poster indberettes, medmindre andet er anført i denne vejledning.

Posterne C0110, C0120, C0121, C0122, C0130, C0140, C0190, C0200, C0230, C0270, C0280, C0310, C0370 og C0380 gælder ikke for CIC 09 — Øvrige investeringer.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om aktiver.

I tabellen »Oplysninger om positioner, der besiddes« skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede ikkemonetære variabler, undtagen posten »Mængde«, i tabellen. Hvis der for det samme aktiv kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende aktiv indberettes i mere end én række.

I tabellen »Oplysninger om aktiver« skal hvert aktiv indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Dette skema anvendes i forbindelse med metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position for aktiver — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De aktiver, der besiddes af de deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- Kapitalinteresser i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra d), e) og f), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes i en række og identificeres ved hjælp af en af valgmulighederne i celle C0310.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de aktiver, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne og datterselskaberne, og en række for hver kapitalinteresse i ikkekontrollerede selskaber. Der tages i de indberettede aktiver ikke hensyn til den forholdsmæssige andel, der anvendes til beregning af koncernsolvensen. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De aktiver, der besiddes af de deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- Kapitalinteresser i forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes i en række for hver kapitalinteresse.
- De aktiver, der besiddes af selskaber i andre finansielle sektorer, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, afspejler en del den konsoliderede position af aktiverne — med fradrag af koncerninterne transaktioner — der skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de aktiver, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne eller de blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, og en række for hver kapitalinteresse i ikkekontrollerede selskaber — med fradrag af koncerninterne transaktioner — uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De aktiver, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- Kapitalinteresser i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra d), e) og f), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes i en række og identificeres ved hjælp af en af valgmulighederne i celle C0310.
- Kapitalinteresser i selskaber, der anvender metode 2, skal indberettes i en række for hvert datterselskab og hver kapitalinteresse i ikkekontrollerede selskaber, og skal identificeres ved hjælp af en af valgmulighederne i C0310.

Den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de aktiver, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne og datterselskaberne, og en række for hver kapitalinteresse i ikkekontrollerede selskaber, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De aktiver, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, der anvender metode 2, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber, der anvendes metode 2 (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- Kapitalinteresser i forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes i en række for hver kapitalinteresse.
- De aktiver, der besiddes af selskaber i andre finansielle sektorer, medregnes ikke.

Oplysningerne om »Ekstern vurdering« (C0320) og »Udpeget ECAI« (C0330) kan begrænses (de indberettes ikke) i følgende tilfælde:

- a) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 254, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, eller
- b) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i tilfælde, hvor forsikrings- og genforsikringsselskaberne har indført outsourcingaftaler vedrørende investeringer, hvilket medfører, at disse specifikke oplysninger ikke er direkte tilgængelige for selskabet.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Oplysninger om positioner, der besiddes

| | | |
|-------|---------------------------------|---|
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder aktivet.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om aktiver, der besiddes af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber, blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, der anvender metoden med fradrag og aggregering.</p> |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------|---|
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvisne til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0060 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, andre interne fonde, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde.</p> <p>Underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Livsforsikring 2 — Skadesforsikring 3 — Ring-fenced fonde 4 — Andre interne fonde 5 — Aktiekapital 6 — Overordnet <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0070 | Fondsnummer | <p>Gælder for aktiver i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret på nationalt plan, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.08.01). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> <p>Fondsnummeret er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed.</p> |
| C0080 | Matchningsportefølje-nummer | <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver matchtilpasningsportefølje som fastsat i artikel 77b, stk. 1, litra a), i direktiv 2009/138/EF. Nummeret skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere matchtilpasningsporteføljen i andre skemaer. Det må ikke genanvendes til en anden matchtilpasningsportefølje.</p> |
| C0090 | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | <p>Angiv de aktiver, der besiddes i unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Unit-linked eller indeksreguleret 2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret |
| C0100 | Aktiv stillet som sikkerhed | <p>Angiv aktiver i selskabets balance, der er stillet som sikkerhed. For aktiver, der kun delvis er stillet som sikkerhed, skal der indberettes to rækker for hvert aktiv; en for den værdi, der er stillet som sikkerhed, og en anden for den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes for aktivet:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Aktiver i balancen, der er stillet som sikkerhed 2 — Sikkerhedsstillelse for accepteret genforsikring 3 — Sikkerhedsstillelse for lånte værdipapirer 4 — Repoer 9 — Ikke sikkerhedsstillelse |
| C0110 | Deponeringsland | <p>»ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor selskabet har deponerede aktiver. Med henblik på identificering af internationale depositarer, som f.eks. Euroclear, er deponeringslandet det land, hvor der er indgået aftale om deponering.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------|--|
| | | <p>Hvis det samme aktiv er deponeret i mere end ét land, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle deponeringslande.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75 og for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver.</p> <p>Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer depotlandet til udstederlandet og fastsættes ud fra ejendommens adresse.</p> |
| C0120 | Depotinstitution | <p>Navnet på det finansieringsinstitut, der er depositar.</p> <p>Hvis det samme aktiv er deponeret hos mere end én depositar, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle deponitarer.</p> <p>For aktiver, der opbevares koncerninternt, indberettes forsikringsselskabet som depositar.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75, CIC 09 og for CIC 9 — Ejendom og for ethvert andet aktiv, som i kraft af sin art ikke er deponeret</p> <p>For aktiver, hvor der ikke er en depositar, eller når denne post ikke finder anvendelse, angives »Ingen depositar«.</p> |
| C0121 | Depositarkode | <p>Angiv koden for depositaren ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0122 | Depositarens kodetype | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Depositarkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> |
| C0130 | Mængde | <p>Antal aktiver for relevante aktiver.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Pariværdi« (C0140) indberettes.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0140 | Pariværdi | <p>Udestående beløb målt til pariværdi, for alle aktiver, hvor denne post er relevant, og til nominal værdi for CIC = 72, 73, 74, 75, 79 og CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån. Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. Denne post indberettes ikke, hvis posten »Mængde« (C0130) indberettes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------------|---|
| C0145 | Langsigtet aktieinvestering | <p>Gælder kun CIC-kategori 3 — Kapitalandele og 4 — Kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>Angiv, om en aktie eller et kollektivt investeringsinstitut er klassificeret i henhold til bestemmelserne i artikel 171a i delegeret forordning (EU) 2015/35. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — Nej</p> <p>9 — Ikke relevant</p> |
| C0150 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte aktiver. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver</p> <p>2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver</p> <p>3 — Alternative værdiansættelsesmetoder</p> <p>4 — Justeret indre værdis metode (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>5 — Indre værdis metode i henhold til IFRS (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> |
| C0160 | Anskaffelsesværdi | <p>Samlet anskaffelsesværdi for de aktiver, der besiddes, ren værdi uden påløbne renter. Gælder ikke relevant for CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud og 8 — Lån, herunder realkreditlån.</p> |
| C0170 | Samlet Solvens II-værdi | <p>Værdi beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, svarende til:</p> <ul style="list-style-type: none"> — »Pariværdi« (udestående hovedstol målt til pariværdi eller nominal værdi) ganget med »Procentsats af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« plus »Påløbne renter«, for aktiver, hvor de første to poster er relevante — mængde« ganget med »Solvens II-pris pr. enhed«, for aktiver, hvor disse to poster er relevante (plus »Påløbne renter«, hvis det er relevant) — Solvens II-værdien af aktivet for aktiver, der kan klassificeres under aktivkategori CIC 71 og CIC-kategori 9 — Ejendom. |
| C0180 | Påløbne renter | <p>Angiv beløbet for påløbne renter efter den sidste kupondato for rentebærende aktiver. Bemærk, at denne værdi også er en del af posten »Samlet Solvens II-værdi«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------|-----------------------|--|
| Oplysninger om aktiver | | |
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være unik og konsistent over tid. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0190 | Betegnelse for posten | <p>Angiv den indberettede post ved at videregive de af selskabet fastsatte oplysninger om navnet på aktivet (eller adresse, hvis det drejer sig om ejendom).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC 87 og CIC 88 skal denne post indeholde »Lån til AMSB-medlemmer«, dvs. lån til administrations-, ledelses- og tilsynsorganet (»AMSB«) eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. Lån til andre end fysiske personer indberettes række for række. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|----------------|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Denne post er ikke relevant for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, eller for CIC 71 og CIC 75 (undtagen hvis påkrævet af den nationale tilsynsmyndighed). — For ejendomme indberettes ISO-landekoden alpha-2 + postnummer + by + gade-adenavn + husnummer) for den ejendom, der besiddes, eller den bredde- og længdegrad eller den CRESTA-/NUTS-region, hvor ejendomsinvesteringen finder sted: administrative grænser (f.eks. provins- eller distriktsgrænse f.eks. NUTS3-niveau) eller sammenlagte postkodeområder (f.eks. de første to tal er postkodeområder, i lighed med de såkaldte »low resolution zones« i CRESTA (Catastrophe Risk Evaluation and Standardising TARGET Accumulations) 2019[2]). |
| C0200 | Udsteders navn | <p>Navnet på udstederen, defineret som den enhed, der udsteder aktiver til investorerne.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederens navn navnet på fondsforvalteren (enheden). Det autoriserede administrationsselskab, som kan have ansvaret, og som har ansvaret for forvaltningen af fonde, er det, der skal indberettes, uanset om nogle af aktiviteterne er blevet outsourcet, herunder den faktiske forvaltning af porteføljen, dvs. købs-/salgsbeslutningen. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederens navn navnet på depositaren. — Hvad angår CIC 87 og CIC 88 skal denne post indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0210 | Udstederkode | <p>Angiv udstederen ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederkoden koden for fondsforvalteren (enheden). Det autoriserede administrationsselskab, som kan have ansvaret, og som har ansvaret for forvaltningen af fonde, er det, der skal indberettes, uanset om nogle af aktiviteterne er blevet outsourcet, herunder den faktiske forvaltning af porteføljen, dvs. købs-/salgsbeslutningen. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederkoden koden for depositaren. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| | | <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88.</p> |
| C0220 | udstederkodetype | <p>Angiv, hvilken type udstederkode der anvendes under »Udstederkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0230 | Udstedersektor | <p>Angiv udstederens økonomiske sektor på grundlag den seneste udgave af NACE-koderne (den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter i EU) (som offentliggjort i en EF-forordning). For NACE-hovedafdelinger A til N kræves der ved fuld indberetning firecifrede NACE-koder, dvs. bogstavet for hovedafdelingen, efterfulgt af den firecifrede kode for kategorien (f.eks. »K6411«). For de resterende hovedafdelinger anvendes bogstavreferencen i NACE-koden, hvorved hovedafdelingen identificeres, som et minimum til identifikation af sektorer (f.eks. ville »P« eller »P8501« kunne godtages).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstedersektoren den sektor, som fondsforvalteren tilhører.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstedersektoren den sektor, som depositaren tilhører.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88.</p> |
| C0240 | Udstedergruppe | <p>Navnet på udstederens øverste moderselskab. For kollektive investeringsinstitutter indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden).</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, vedrører koncerntilhørsforholdet låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for obligationer udstedt af: <ul style="list-style-type: none"> — en centralregering — et lokalt forvaltningsniveau — et offentligt organ — en centralbank — koncernen/enheden selv — en overstatslig organisation (såfremt der ikke findes en udstederkoncern) |
| C0250 | Udstedergruppekode | <p>Angiv udstedergruppens identifikation ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, indberettes det øverste moderselskab for fondsforvalteren (enheden). — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, vedrører koncerntilhørsforholdet låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for obligationer udstedt af: <ul style="list-style-type: none"> — en centralregering — et lokalt forvaltningsniveau — et offentligt organ — en centralbank — koncernen/enheden selv — en overstatslig organisation (såfremt der ikke findes en udstederkoncern) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| C0260 | Type udstedergruppekode | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Udstedergruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> |
| C0270 | Udstederland | <p>ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor udstederen befinder sig.</p> <p>Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederlandet fondsforvalterens (enhedens) land. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstederlandet depositarens land. — Hvad angår CIC 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode — XA: Overstatslige udstedere (offentlige institutioner, der er oprettet ved en aftale mellem nationalstater, f.eks. ved værdipapirer udstedt af en multilateral udviklingsbank som omhandlet i artikel 117, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller værdipapirer udstedt af en international organisation som omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, med undtagelse af Den Europæiske Unions institutioner) — EU: Den Europæiske Unions institutioner (jf. artikel 13 i Traktaten om Den Europæiske Union). |
| C0280 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Denne post er ikke relevant for CIC 87 og CIC 88, da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, for CIC 75, CIC 09 og CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug) af samme grund. — Hvad angår CIC-kategori 9 — Ejendom, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer valuta til den valuta, som investeringen blev foretaget i. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0290 | CIC | <p>Den CIC-kode, der anvendes til at klassificere aktiver som fastsat i bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når et aktiv klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som aktivet er eksponeret for.</p> <p>Moderselskabet skal kontrollere og sikre, at den CIC-kode, der anvendes for det samme værdipapir fra forskellige selskaber, er den samme i indberetningen på koncernniveau.</p> |
| C0293 | Bestemmelser om bail-in | <p>Angiv, om aktivet er underlagt bestemmelser om bail-in i overensstemmelse med artikel 43 og 44 i direktiv 2014/59/EU (direktivet om genopretning og afvikling af banker — BRRD)</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ja</p> <p>2 — nej</p> <p>9 — ikke relevant.</p> |
| C0294 | Regionale regeringer og lokale myndigheder | <p>Angiv, om aktiver udstedt eller garanteret af regionale regeringer og lokale myndigheder, uanset om de er opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, vedrørende aktiver, der kan klassificeres under CIC 13 og 14.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011</p> <p>2 — Ikke opført i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011</p> <p>9 — ikke relevant.</p> |
| C0295 | Kryptoaktiver | <p>Angiv aktiver, der er knyttet til kryptoaktiver.</p> <p>»Kryptoaktiv«: en digital gengivelse af værdi eller rettigheder, som kan overføres og lagres elektronisk ved hjælp af distributed ledger-teknologi eller lignende teknologi</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — »Elektronisk pengetoken«: en form for kryptoaktiv, hvis hovedformål er anvendelse som et omsætningsmiddel, og som hævdes at bevare en stabil værdi ved at henvise til værdien af en fiatvaluta, der er lovligt betalingsmiddel</p> <p>2 — »Aktivbaseret token«: en form for kryptoaktiv, som hævdes at bevare en stabil værdi, ved at henvise til værdien af flere fiatvalutaer, der er lovlige betalingsmidler, en eller flere råvarer eller et eller flere kryptoaktiver, eller en kombination af sådanne aktiver</p> <p>3 — »Utility token«: en form for kryptoaktiv, som er beregnet til at give digital adgang til en vare eller en tjenesteydelse, der er tilgængelig i forbindelse med DLT, og som kun kan accepteres af udsteder af denne token</p> <p>4 — Øvrige kryptoaktiver</p> <p>5 — Nej</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|--|
| C0296 | Ejendomstype | <p>Angiv ejendomstype i henhold til ESRB's henstilling af 21. marts 2019 om ændring af henstilling ESRB/2016/14 om lukning af datahuller vedrørende fast ejendom.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — beboelse, f.eks. boliger med flere husholdninger</p> <p>2 — detailhandel, f.eks. hoteller, restauranter, indkøbscentre</p> <p>3 — kontorer, f.eks. en ejendom, der primært bruges som erhvervs- eller forretningsmæssige kontorer</p> <p>4 — industri, f.eks. en ejendom, der bruges til produktion, distribution og logistik</p> <p>5 — andre typer erhvervsjendomme</p> <p>9 — ikke relevant.</p> <p>Såfremt en fast ejendom bruges til flere formål, betragtes den som forskellige ejendomme (f.eks. baseret på det overfladeareal, der vedrører de respektive brugstyper), hvis en sådan specifikation er mulig, ellers kan ejendommen klassificeres efter den dominerende brug</p> <p>Denne post er kun relevant for CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0297 | Ejendommens beliggenhed | <p>Angiv ejendomsbeliggenhed i henhold til ESRB's henstilling af 21. marts 2019 om ændring af henstilling ESRB/2016/14 om lukning af datahuller vedrørende fast ejendom.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Bedste beliggenhed</p> <p>2 — Anden beliggenhed</p> <p>9 — ikke relevant.</p> <p>Denne post er kun relevant for CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0300 | Infrastrukturinvestering | <p>Angiv, om aktivet er en infrastrukturinvestering som defineret i artikel 1, nr. 55a) og 55b), i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ikke en infrastrukturinvestering</p> <p>2 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: offentlig garanti (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>3 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: initiativ med offentlig støtte, herunder offentlig-private partnerskaber (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>4 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: initiativ med overstatslig garanti/støtte (ECB, multilateral udviklingsbank, international organisation)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>9 — Infrastruktur, ikke-kvalificeret: andre ikke-kvalificerede infrastrukturlån eller -investeringer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier</p> <p>12 — Infrastruktur, kvalificeret: offentlig garanti (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>13 — Infrastruktur, kvalificeret: initiativ med offentlig støtte, herunder offentlig-private partnerskaber (staten, centralbank, regional regering eller lokal myndighed)</p> <p>14 — Infrastruktur, kvalificeret: initiativ med overstatslig garanti/støtte (ECB, multilateral udviklingsbank, international organisation)</p> <p>19 — Infrastruktur, kvalificeret: andre kvalificerede infrastrukturinvesteringer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier</p> <p>20 — europæisk langsigtet investeringsfond (ELTIF, der investerer i infrastrukturaktiver, og ELTIF, der investerer i andre aktiver (ikke infrastrukturaktiver))</p> |
| C0310 | Besiddelser i tilknyttede selskaber, herunder kapitalinteresser | <p>Gælder kun for CIC-kategori 3 — Kapitalandele og 4 — Kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>Angiv, om en aktie eller anden andel er en kapitalinteresse.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ikke en kapitalinteresse</p> <p>2 — Kapitalinteresse i et ikkekontrolleret tilknyttet forsikrings- og genforsikringsselskab, der anvender metode 1</p> <p>3 — Kapitalinteresse i et ikkekontrolleret tilknyttet forsikrings- og genforsikringsselskab, der anvender metode 2</p> <p>4 — Kapitalinteresse i anden finansiel sektor</p> <p>5 — Datterselskab, der anvender metode 2</p> <p>6 — Kapitalinteresse i et andet strategisk tilknyttet forsikrings- og genforsikringsselskab, der anvender metode 1</p> <p>7 — Kapitalinteresse i et andet ikkestrategisk tilknyttet forsikrings- og genforsikringsselskab, der anvender metode 1</p> <p>8 — Andre kapitalinteresser (f.eks. kapitalinteresser i andre selskaber, der anvender metode 2)</p> |
| C0320 | Ekstern rating | <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer og 6 — Sikrede værdipapirer, CIC 87 og CIC 88, hvor det måtte være relevant.</p> <p>Udstedelsesvurderingen af aktivet pr. referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Hvis der ikke foreligger en udstedelsesvurdering, udfyldes denne post ikke.</p> <p>Hvis der indberettes »Mange ECAI'er« i C0330, indberettes den mest repræsentative eksterne vurdering.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------|---|
| C0330 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0320, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger udstedt af ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med forordning (EF) nr. 1060/2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån (undtagen CIC 87 og CIC 88), hvor det måtte være relevant.</p> <p>Denne post indberettes, når »Ekstern vurdering« (C0320) indberettes. Hvis »Der er ikke udpeget et ECAI, og der anvendes en forenkling til at beregne SCR«, udfyldes Ekstern vurdering (C0320) ikke, og i Kreditkvalitetstrin (C0340) anvendes en af følgende valgmuligheder: 2a, 3a eller 3b.</p> |
| C0340 | Kreditkvalitetstrin | <p>Relevant for alle aktiver, til hvilke der skal henføres kreditkvalitetstrin med henblik på beregningen af solvenskapitalkravet.</p> <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt aktivet, jf. artikel 109a, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF ved anvendelse af den konverteringstabel, der anføres i gennemførelsesforordning (EU) 2016/1800.</p> <p>Kreditkvalitetstrinnet skal især afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> <p>Denne post er ikke relevant for aktiver, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>2a — Kreditkvalitetstrin 2 som følge af anvendelsen af artikel 176a i delegeret forordning (EU) 2015/35 i forbindelse med ikke-vurderede obligationer og lån</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>3a — Kreditkvalitetstrin 3 som følge af anvendelsen af forenklet beregning i henhold til artikel 105a i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>3b — Kreditkvalitetstrin 3 som følge af anvendelsen af artikel 176a i delegeret forordning (EU) 2015/35 i forbindelse med ikke-vurderede obligationer og lån</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0350 | Intern vurdering | <p>Gælder som minimum for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån (undtagen CIC 87 og CIC 88), hvor det måtte være relevant.</p> <p>Intern vurdering af aktiver for selskaber, der bruger interne vurderinger</p> <p>For selskaber, der anvender matchtilpasning, indberettes posten, i det omfang de interne vurderinger anvendes til beregning af det grundlæggende spread, jf. artikel 77c, stk. 2.</p> |
| C0360 | Varighed | <p>Gælder kun for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 4 — Kollektive investeringsinstitutter (hvis det er relevant, f.eks. for kollektive investeringsinstitutter, der hovedsageligt investerer i obligationer), 5 — Strukturerede værdipapirer og 6 — Sikrede værdipapirer.</p> <p>Aktivets varighed, defineret som »resterende modificeret varighed« (modificeret varighed, der er beregnet på grundlag af værdipapirets restløbetid, regnet fra referencedatoen for indberetningen). For aktiver uden faste løbetider anvendes den første indløsningsdato, men sandsynligheden, for at call-optionen gøres gældende, skal tages i betragtning. Varigheden skal beregnes på grundlag af den økonomiske værdi.</p> |
| C0370 | Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i indberetningsvalutaen, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »mængde« (C0130) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«).</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« (C0380) indberettes.</p> |
| C0380 | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i procent af pariværdi, »clean price« uden påløbne renter, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »pariværdi« (C0140) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«), undtagen for CIC 71 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Solvens II-pris pr. enhed« (C0370) indberettes.</p> |
| C0390 | Udløbsdato | <p>Gælder kun for CIC-kategori 1 — Statsobligationer, 2 — Erhvervsobligationer, 5 — Strukturerede værdipapirer, 6 — Sikrede værdipapirer og 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 74 og CIC 79.</p> <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for forfaldsdatoen.</p> <p>Svarer altid til forfaldsdatoen, selv for værdipapirer, som kan kræves indkaldt.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For værdipapirer uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«. — For CIC 87 og CIC 88 indberettes den vægtede (på basis af lånebeløbet) restløbetid. |

S.06.03 — Kollektive investeringsinstitutter — se-igennem-metode

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indeholder oplysninger anført efter se igennem-metoden for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde og lignende selskaber, herunder også når det drejer sig om kapitalinteresser, efter det underliggende aktivs kategori, udstedelsesland og valuta. Se-igennem-metoden skal anvendes, indtil aktivkategorierne, landene og valutaerne er identificeret. Under hensyn til proportionaliteten og den specifikke vejledning til skemaet anvendes se-igennem-metoden, indtil kategorierne, landene og valutaerne er identificeret. Hvad angår fonde, der investerer i andre fonde, skal se-igennem-metoden anvendes efter samme princip.

Skemaet skal indeholde oplysninger svarende til 100 % af den værdi, der er investeret i kollektive investeringsinstitutter. Med henblik på at identificere lande skal se-igennem-metoden dog anvendes for at identificere eksponeringer for 90 % af det samlede beløb for fondene minus de beløb, der vedrører CIC 8 og 9, og med henblik på at identificere valutaer skal se-igennem-metoden anvendes for at identificere eksponeringer for 90 % af det samlede beløb for fondene. Koncerner skal sikre, at de 10 %, der ikke er identificeret efter land, er diversificeret over geografiske områder, dvs. eksempelvis at højst 5 % befinder sig i ét og samme land. Se-igennem-metoden skal anvendes af koncerner, idet man begynder med den største, under hensyn til det investerede beløb, til den mindste enkelte fond, og metoden skal forblive konsistent over tid.

Oplysninger, der indberettes hvert kvartal, skal kun indberettes, når den andel af kollektive investeringsinstitutter, som besiddes af koncernen, af de samlede investeringer, målt som forholdet mellem post C0010/R0180 i skema S.02.01 plus kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0220 i skema S.02.01 plus kollektive investeringsinstitutter under post C0010/R0090 og summen af post C0010/R0070 og C0010/RC0220 i skema S.02.01 overstiger 30 %, når kun metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes. Når metode 1 anvendes sammen med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene, skal andelen justeres for at afspejle posterne hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Dette skema skal indeholde oplysninger anført efter se igennem-metoden for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde og lignende selskaber, herunder også når det drejer sig om kapitalinteresser, efter det underliggende aktivs kategori, indberettet post for post i S.06.02. Hvis et kollektivt investeringsinstitut eller en investering pakket som fond og lignende selskab, besiddes af mange selskaber, skal de i dette skema kun indberettes én gang.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------|---|
| C0010 | UCI-ID-kode | Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af koncernen, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0020 | ID-kodetype for kollektivt investeringsselskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af koncernen |
| C0030 | Kategori for underliggende aktiv | <p>Angiv aktivkategorier, tilgodehavender og derivater i instituttet for kollektiv investering. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Statsobligationer 2 — Erhvervsobligationer 3L — Noterede aktier 3X — Unoterede aktier 4 — Kollektive investeringsinstitutter 5 — Strukturerede værdipapirer 6 — Sikrede værdipapirer 7 — Kontanter og indskud 8 — Lån, herunder realkreditlån 9 — Ejendomme 0 — Øvrige investeringer (herunder tilgodehavender) A — Futures B — Call-optioner C — Put-optioner D — Swaps E — Forwards F — Kreditderivater L — Forpligtelser <p>Kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter» anvendes kun for uvæsentlige restværdier for både fonde, der investerer i andre fonde, og alle andre typer fonde.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------|--|
| C0040 | Udstedelsesland | <p>Specifikation af hver aktivkategori angivet under post C0030 efter udstederland. Angiv det land, hvor udstederen befinder sig.</p> <p>Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 alpha-2-kode — XA: Supranationale udstedere — EU: Den Europæiske Unions institutioner — AA: aggregerede lande, da der anvendes en tærskel <p>Denne post er ikke relevant for kategori 7, 8 og 9, da den indberettes under C0030.</p> |
| C0050 | Valuta | <p>Angiv, om aktivkategoriens valuta er indberetningsvalutaen eller en fremmed valuta. Alle andre valutaer end indberetningsvalutaen anses for at være fremmede valutaer. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Indberetningsvaluta 2 — Fremmed valuta 3 — Aggregerede valutaer, da der anvendes en tærskel |
| C0060 | Samlet beløb | <p>Det samlede investerede beløb efter aktivkategori, land og valuta gennem kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>For forpligtelser skal der indberettes en positiv værdi, medmindre posten er en derivatforpligtelse.</p> <p>For derivater kan den samlede værdi være positiv (hvis der er tale om et aktiv) eller negativ (hvis der er tale om en forpligtelse).</p> |

S.07.01 — Strukturerede produkter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Strukturerede produkter defineres som aktiver, der hører ind under aktivkategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer).

Dette skema indberettes kun, hvis mængden af strukturerede produkter, målt som andelen mellem aktiver klassificeret i aktivkategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer) som defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning og summen af post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01, overstiger 5 %, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes alene. Når metode 1 anvendes sammen med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene, skal andelen justeres for at afspejle posterne hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.

I nogle tilfælde angiver typerne af strukturerede produkter (C0070), hvilket derivat der er indbygget i det strukturerede produkt. Hvis det strukturerede produkt har det pågældende derivat indbygget, anvendes denne klassificering.

Dette skema anvendes i forbindelse med metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position for de strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet, og som besiddes i porteføljen. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De strukturerede produkter, der besiddes direkte af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne eller de blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De strukturerede produkter, der besiddes direkte af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- De strukturerede produkter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, afspejler en del af indberetningen den konsoliderede position af de strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet, og som skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de strukturerede værdipapirer og sikrede værdipapirer, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De strukturerede produkter, der besiddes direkte af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Den anden del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De strukturerede produkter, der besiddes direkte af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, der anvendes metode 2, skal indberettes post for post.
- De strukturerede produkter, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber i henhold til metode 2 (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- De strukturerede produkter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, der anvender metode 2, medregnes ikke.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder det strukturerede produkt.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om strukturerede produkter, der besiddes af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, der anvender metoden med fradrag og aggregering.</p> |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Identifikationskoden for det strukturerede produkt som indberettet i S.06.02 (i følgende prioriterede rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Den anvendte kode skal forblive konsistent over tid og må ikke genanvendes til andre produkter. <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henviser til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------|--|
| C0060 | Sikkerhedsstillelsestype | <p>Angiv sikkerhedsstillelsestypen ved hjælp af de aktivkategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Statsobligationer 2 — Erhvervsobligationer 3 — Kapitalandele 4 — Kollektive investeringsinstitutter 5 — Strukturerede værdipapirer 6 — Sikrede værdipapirer 7 — Kontanter og indskud 8 — Lån, herunder realkreditlån 9 — Ejendomme 0 — Øvrige investeringer 10 — Ingen sikkerhedsstillelse <p>Hvis der findes mere end én kategori af sikkerhedsstillelse for et enkelt struktureret produkt, indberettes den mest repræsentative.</p> |
| C0070 | Type struktureret produkt | <p>Angiv typen af struktur for produktet. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Credit linked notes <p>Værdipapir eller indskud med et indbygget kreditderivat (f.eks. credit default swaps eller credit default-optioner)</p> <ol style="list-style-type: none"> 2 — Constant maturity swaps (CMS) <p>(værdipapir med indbygget renteswap, hvor andelen med variabel rente periodisk tilpasses til en markedsrente for faste løbetider)</p> <ol style="list-style-type: none"> 3 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver <p>(værdipapir, der har et aktiv som sikkerhedsstillelse)</p> <ol style="list-style-type: none"> 4 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom <p>(værdipapir, der har fast ejendom som sikkerhedsstillelse)</p> <ol style="list-style-type: none"> 5 — Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsjendom <p>(værdipapir, der har erhvervsjendom som sikkerhedsstillelse, f.eks. detailejendomme, industriejendomme, flerfamiliehuse og hoteller)</p> <ol style="list-style-type: none"> 6 — Strukturerede kreditobligationer |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>(struktureret gældsbevis med sikkerhed i en portefølje bestående af sikrede eller usikrede obligationer (erhvervsobligationer eller statsobligationer) eller af sikrede eller usikrede lån til kommercielle og industrielle virksomheder, som er lånekunder i udlånsbanker)</p> <p>7 — Collateralised loan obligations (CLO-obligationer)</p> <p>(værdipapir, der som underliggende aktiv har en portefølje af lån, hvor cash flowet fra værdipapiret er afledt af porteføljen)</p> <p>8 — Collateralised mortgage obligations (CMO-obligationer)</p> <p>(investment grade-værdipapir understøttet af en pulje af obligationer, lån og andre aktiver)</p> <p>9 — Værdipapirer og indskud knyttet til rentesats</p> <p>10 — Aktiebaserede værdipapirer og indskud og aktieindeksbaserede værdipapirer og indskud</p> <p>11 — Værdipapirer og indskud knyttet til valuta og råvarer</p> <p>12 — Værdipapirer og indskud knyttet til hybridinstrumenter (heri indgår fast ejendom og aktier)</p> <p>13 — Værdipapirer og indskud knyttet til markedet</p> <p>14 — Værdipapirer og indskud knyttet til forsikring, herunder værdipapirer, der omfatter katastrofe- og vejrrisici samt dødelighedsrisici</p> <p>99 — Andet ikke omfattet af foregående valgmuligheder</p> |
| C0080 | Kapitalbeskyttelse | <p>Angiv, om produktet er kapitalbeskyttet. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Fuldstændig kapitalbeskyttelse</p> <p>2 — Delvis kapitalbeskyttelse</p> <p>3 — Ingen kapitalbeskyttelse</p> |
| C0090 | Underliggende værdipapir/indeks/portefølje | <p>Beskriv typen af underliggende aktiv. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Aktier og fonde (en udvalgt gruppe eller kurv af aktier)</p> <p>2 — Valuta (en udvalgt gruppe eller kurv af valutaer)</p> <p>3 — Rentesats og afkast (obligationsindeks, afkastkurver, forskelle i gældende rentesatser for kortere og længere løbetider, kreditspænd, inflationsrate og andre benchmarks for rentesats eller afkast)</p> <p>4 — Råvarer (en udvalgt vare eller gruppe af varer)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>5 — Indeks (resultaterne af et udvalgt indeks)</p> <p>6 — Flere (giver mulighed for at kombinere ovenstående mulige typer)</p> <p>9 — Andet ikke omfattet af foregående valgmuligheder (f.eks. andre økonomiske indikatorer)</p> |
| C0100 | Callable eller putable | <p>Angiv, om produktet har call- og/eller put-karakteristika eller begge, hvis det er relevant. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Købers call-option</p> <p>2 — Sælgers call-option</p> <p>3 — Købers put-option</p> <p>4 — Sælgers put-option</p> <p>5 — Enhver kombination af ovenstående valgmuligheder</p> <p>6 — Ikke relevant</p> |
| C0110 | Syntetisk struktureret produkt | <p>Angiv, om det er et struktureret produkt uden overdragelse af aktiver (f.eks. produkter, der ikke giver anledning til levering af aktiver, bortset fra kontanter, hvis der indtræder en ugunstig/gunstig hændelse). En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Struktureret produkt uden overdragelse af aktiv</p> <p>2 — Struktureret produkt med overdragelse af aktiv</p> |
| C0120 | Struktureret produkt med førtidig indfrielse | <p>Angiv, om det er et struktureret produkt med mulighed for førtidig indfrielse, som betragtes som en tidlig ikkeplanlagt tilbagebetaling af hovedstolen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Struktureret produkt med førtidig indfrielse</p> <p>2 — Ikke et struktureret produkt med førtidig indfrielse</p> |
| C0130 | Værdi af sikkerhedsstillelse | <p>Den samlede sikkerhedsstillelse i forbindelse med det strukturerede produkt uanset arten af sikkerhedsstillelsen.</p> <p>I tilfælde af sikkerhedsstillelse på grundlag af en portefølje indberettes kun den værdi, der vedrører den enkelte kontrakt, og ikke den samlede værdi.</p> |
| C0140 | Sikkerhedsstillelse på portefølgebasis | <p>I denne post oplyses om, hvorvidt sikkerhedsstillelsen for det strukturerede produkt dækker ét struktureret produkt eller mere end ét struktureret produkt, der besiddes af selskabet. Nettopositioner vedrører positionerne for strukturerede produkter. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Sikkerhedsstillelse beregnet på grundlag af nettopositioner opgjort ud fra et sæt kontrakter</p> <p>2 — Sikkerhedsstillelse beregnet på grundlag af én enkelt kontrakt</p> <p>10 — Ingen sikkerhedsstillelse</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|---|
| C0150 | Fast årligt afkast | Angiv kuponen (indberettes som decimaltal), hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). |
| C0160 | Variabelt årligt afkast | Angiv det variable afkast, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Det angives normalt som en benchmark-markedsrente plus et spænd eller som afhængig af resultaterne af en portefølje eller et indeks (afhængig af underliggende) eller mere komplekse afkast, som bl.a. afhænger af stien for det underliggende aktivs pris (stiafhængig). Når det er nødvendigt, kan denne post indberettes som en streng for at afspejle, hvordan afkastet beregnes. |
| C0170 | Tab givet misligholdelse | Procenten (indberettet som decimaltal), af det investerede beløb, som ikke vil blive inddrevet efter misligholdelse, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Hvis de pågældende oplysninger ikke er defineret i kontrakten, skal denne post ikke indberettes. Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |
| C0180 | Attachment point | Den kontraktligt fastsatte tabsprocent (indberettet som decimaltal), over hvilken tabene påvirker det strukturerede produkt, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |
| C0190 | Detachment point | Den kontraktligt fastsatte tabsprocent (indberettet som decimaltal), over hvilken tabene ophører med at påvirke det strukturerede produkt, hvis det er relevant, for CIC-kategori 5 (strukturerede værdipapirer) og 6 (sikrede værdipapirer). Denne post er ikke relevant for strukturerede produkter, der ikke er gældsforpligtelser. |

5.08.01 — Åbne derivater

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

De i dette skema omhandlede derivatkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Skemaet indeholder en post-for-post-liste over derivater, der besiddes direkte af koncernen (dvs. ikke efter seigennem-metoden), og som kan klassificeres i aktivkategori A-F.

Dette skema omfatter derivater, der handles på en fondsbørs eller på et tilsvarende centraliseret marked, og derivater, der handles OTC.

Når et derivat handles på en fondsbørs eller på et tilsvarende centraliseret marked, er modparten fondsbørsen eller et tilsvarende centraliseret marked og ikke den ultimative modpart, som det er tilfældet for derivater, der handles OTC.

Derivater betragtes som aktiver, hvis deres Solvens II-værdi er positiv eller nul. De betragtes som forpligtelser, hvis deres Solvens II-værdi er negativ. Både derivater, der betragtes som aktiver, og derivater, der betragtes som forpligtelser, skal medtages.

Oplysningerne skal omfatte alle derivatkontrakter, der forelå i indberetningsperioden, og som ikke var afsluttet inden referencdatoen for indberetningen.

Hvis der er hyppige handler med det samme derivat, hvilket medfører mange åbne positioner, kan derivatet indberettes på aggregeret basis eller på nettobasis, når blot alle relevante egenskaber er fælles og følger den specifikke vejledning for hver enkelt relevant post.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

Et derivat er et finansielt instrument eller anden kontrakt, som har alle tre nedenstående egenskaber:

- a) Dets værdi ændres som følge af ændringer i en specifik rentesats, kurs på et finansielt instrument, råvarepris, valutakurs, pris- eller renteindeks, kreditvurdering eller kreditindeks eller lignende variabler, forudsat i tilfælde af ikkefinansielle variabler, at disse variabler ikke gælder specifikt for en kontrahent (undertiden benævnt som »underliggende«).
- b) Det kræver ingen nettoinvestering ved indgåelsen, eller det kræver en nettoinvestering ved indgåelsen, som er mindre, end hvad der kræves for andre typer kontrakter, der kunne forventes at påvirkes på tilsvarende måde af ændrede markedsvilkår.
- c) Det afregnes på et fremtidigt tidspunkt.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om derivater.

I tabellen »Oplysninger om positioner« skal hvert derivat indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede ikkemonetære variabler i tabellen. Hvis der for det samme derivat kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende derivat indberettes i mere end én række.

Især for så vidt angår derivater, der har mere end ét valutapar, skal det opdeles i parkomponenterne og indberettes i forskellige rækker.

I tabellen »Oplysninger om derivater« skal hvert derivat indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position for derivater — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De derivater, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De derivater, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- Derivater, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, *medregnes ikke*.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de derivater, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne eller de blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De derivater, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De derivater, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- De derivater, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, skal en del af indberetningen afspejle den konsoliderede position af de derivater — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet, og som skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de derivater, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De derivater, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De derivater, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- Derivater, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Den anden del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De derivater, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, der anvender metode 2, skal indberettes post for post.
- De derivater, der besiddes af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber, der anvendes metode 2 (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post efter selskab.
- De derivater, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, der anvender metode 2, medregnes ikke.

Oplysningerne om »Ekstern vurdering« (C0290) og »Udpeget ECAI« (C0300) kan begrænses (de indberettes ikke) i følgende tilfælde:

- a) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i henhold til artikel 254, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, eller
- b) efter en afgørelse, der træffes af den nationale tilsynsmyndighed i tilfælde, hvor forsikrings- og genforsikringsselskaberne har indført outsourcingaftaler vedrørende investeringer, hvilket medfører, at disse specifikke oplysninger ikke er direkte tilgængelige for selskabet.

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---------------------------------|--|
| Oplysninger om positioner, der besiddes | | |
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder derivatet.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om derivater, der besiddes af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber, blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, der anvender metoden med fradrag og aggregering.</p> |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Derivat-ID-kode | <p>Derivat-ID-kode i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0041 | Entydig transaktionsidentifikator (Unique transaction identifier) | <p>Angiv de transaktionsidentifikatorer, der er anvendt i handelsrapporterne til transaktionsregistre i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre.</p> <p>Under denne post indberettes så mange transaktionsidentifikatorer som nødvendigt for at kunne etablere den position, der indberettes. Transaktionsidentifikatorer indberettes adskilt ved komma.</p> <p>Denne post indberettes med »Intet ID«, når derivatet ikke falder ind under forordning (EU) nr. 648/2012.</p> |
| C0050 | Derivat-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Derivat-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> |
| C0060 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde.</p> <p>Underliggende derivater for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende derivater for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Livsforsikring</p> <p>2 — Skadesforsikring</p> <p>3 — Ring-fenced fonde</p> <p>4 — Andre interne fonde</p> <p>5 — Aktiekapital</p> <p>6 — Overordnet</p> <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0070 | Fondsnummer | <p>Gælder for derivater i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret på nationalt plan, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.06.02). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> |
| C0080 | Derivater i unit-linked og indeksregulerede aftaler | <p>Angiv de derivater, der besiddes i forbindelse med unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Unit-linked eller indeksreguleret</p> <p>2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret</p> |
| C0090 | Underliggende instrument for derivatet | <p>ID-kode for det underliggende instrument (aktiv eller forpligtelse) for derivatkontrakten. Denne post skal kun indberettes for derivater, der har et enkelt eller mange underliggende instrumenter i selskabets portefølje. Et indeks betragtes som et enkelt instrument og skal indberettes.</p> <p>Identifikationskode for det underliggende instrument for derivatet i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, for det underliggende instrument, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være unik og konsistent over tid for dette instrument — »Mange aktiver/forpligtelser«, hvis der er mere end ét underliggende aktiv eller én underliggende forpligtelse. <p>Hvis det underliggende instrument er et indeks, så indberettes koden for indekset.«</p> |
| C0100 | Kodetype for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet. | <p>Type ID-kode anvendt under »Det underliggende instrument for derivatet«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|--|
| | | <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (global identifikator for finansielle instrumenter)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet, hvis ingen af ovenstående muligheder er tilgængelige. Denne valgmulighed anvendes ligeledes i forbindelse med »Mange aktiver/forpligtelser« og indeks.</p> |
| C0110 | Brug af derivat | <p>Beskriv brugen af derivatet (mikro-/makroafdækning, effektiv porteføljevaltning).</p> <p>Mikroafdækning vedrører derivater, der dækker ét enkelt finansielt instrument (aktiv eller forpligtelse), én enkelt forventet transaktion eller én enkelt anden forpligtelse.</p> <p>Makroafdækning vedrører derivater, der dækker et sæt finansielle instrumenter (aktiver eller forpligtelser), forventede transaktioner eller andre forpligtelser.</p> <p>Effektiv forvaltning af porteføljen refererer normalt til aktiviteter, hvor forvalteren ønsker at forbedre porteføljens indtægter ved at erstatte et (lavere) cash flow-mønster med et andet med en højere værdi ved hjælp af et derivat eller sæt af derivater — uden at ændre aktivporteføljens sammensætning — med lavere investeringsbeløb og færre transaktionsomkostninger.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Mikroafdækning</p> <p>2 — Makroafdækning</p> <p>3 — Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser anvendt i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer</p> <p>4 — Effektiv porteføljevaltning bortset fra »Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser« anvendt i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer</p> |
| C0131 | Notionelt beløb for derivatet | <p>Det beløb, der er dækket eller eksponeret i forbindelse med derivatet, indberettet i den oprindelige valuta.</p> <p>For futures og optioner svarer det til kontraktstørrelse ganget med den udløsende værdi og med antal aftaler, der er indberettet i denne række. For swaps og forwards svarer det til kontraktbeløbet for de kontrakter, der er indberettet i denne række. Hvis den udløsende værdi svarer til et interval, anvendes gennemsnitsværdien for intervallet.</p> <p>Den notionelle værdi henviser til det beløb, der sikres/investeres (når ingen risici dækkes). Hvis der forekommer flere handler, er der tale om nettobeløbet på indberetningsdatoen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------|---|
| C0140 | Køber/sælger | <p>Kun for aftaler om futures og optioner, swaps og kreditderivater</p> <p>Angiv, om derivatkontrakten blev købt eller solgt.</p> <p>Køber- eller sælgerpositionen for swaps defineres i forhold til værdipapiret eller det notionelle beløb og swap flow.</p> <p>En sælger af en swap ejer værdipapiret eller det notionelle beløb ved aftalens indgåelse og erklærer sig villig til, i løbet af kontraktens løbetid, at levere dette værdipapir eller notionelle beløb, herunder alle andre udgående strømme, som er forbundet med kontrakten, hvis det er relevant.</p> <p>En køber af en swap vil eje værdipapiret eller det notionelle beløb ved derivatkontraktens udløb og vil i løbet af kontraktens løbetid modtage dette værdipapir eller notionelle beløb, herunder alle andre indgående strømme, som er forbundet med kontrakten, hvis det er relevant.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes, dog ikke for renteswaps:</p> <p>1 — Køber</p> <p>2 — Sælger</p> <p>For renteswaps anvendes en af valgmulighederne i følgende udtømmende liste:</p> <p>3 — FX—FL: leveres fixed-for-floating</p> <p>4 — FX—FX: leveres fixed-for-floating</p> <p>5 — FX—FX: leveres floating-for-fixed</p> <p>6 — FX—FX: leveres floating-for-floating</p> |
| C0150 | Til dato betalt præmie | Betaling erlagt (hvis købt) for optioner og forudbetalinger og periodiske præmiebeløb betalt for swaps siden det øjeblik, hvor selskabet indgik derivatkontrakten. |
| C0160 | Til dato modtaget præmie | Betaling modtaget (hvis solgt) for optioner og forudbetalinger og periodiske præmiebeløb modtaget for swaps siden det øjeblik, hvor selskabet indgik derivatkontrakten. |
| C0170 | Antal kontrakter | <p>Antal lignende derivatkontrakter indberettet i rækken. Det skal være det antal kontrakter, der er indgået. For over the counter-derivater indberettes f.eks. én swapkontrakt som »1«, mens ti swaps med samme karakteristika indberettes som »10«.</p> <p>Antallet af aftaler kan være et ikkeheltal, hvis der er behov for at opdele aftaler.</p> <p>Antallet af kontrakter skal svare til dem, der var udestående på indberetningsdatoen.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0180 | Kontraktstørrelse | <p>Antal underliggende aktiver i kontrakten (for aktiefutures er det f.eks. antal aktier, der skal overdrages pr. derivatkontrakt ved udløb, for obligationsfutures er det det for hver kontrakt underliggende referencebeløb).</p> <p>Den måde, hvorpå kontraktstørrelsen fastsættes, varierer afhængigt af instrumenttype. For aktiefutures er det almindeligt, at kontraktstørrelsen fastsættes i forhold til antal underliggende aktier.</p> <p>For obligationsfutures er det den for kontrakten underliggende nominelle værdi.</p> <p>Kun relevant for futures og optioner.</p> |
| C0190 | Maksimalt tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling | <p>Maksimumsbeløbet for tab, hvis der indtræffer en hændelse, der fører til afvikling. Kun relevant for CIC-kategori F.</p> <p>Hvis der er 100 % sikkerhedsstilling for et kreditderivat, er det maksimale tab i tilfælde af en hændelse, der fører til afvikling, nul.</p> |
| C0200 | Swap — Udgående beløbsstrømme | <p>Beløb, der er afleveret i henhold til swapkontrakten (bortset fra præmier) i løbet af indberetningsperioden. Svarer til den rente, der er betalt for renteswaps, og de beløb, der er afleveret for valutaswaps, creditswaps, total-afkast-swaps og andre swaps.</p> <p>I tilfælde, hvor afviklingen finder sted på nettobasis, indberettes kun én af posterne C0200 og C0210.</p> |
| C0210 | Swap — Indgående beløbsstrømme | <p>Beløb, der er modtaget i henhold til swapkontrakten (bortset fra præmier) i løbet af indberetningsperioden. Svarer til den rente, der er modtaget for renteswaps, og de beløb, der er modtaget for valutaswaps, creditswaps, total-afkast-swaps og andre swaps.</p> <p>I tilfælde, hvor afviklingen finder sted på nettobasis, indberettes kun én af posterne C0200 og C0210.</p> |
| C0220 | Begyndelsesdato | <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken forpligtelserne i henhold til aftalen får virkning.</p> <p>Hvis der optræder forskellige datoer for det samme derivat, indberettes kun den første handelsdato for derivatet og kun én række for hvert derivat (ikke forskellige rækker for hver handel), som afspejler det samlede beløb, der er investeret i dette derivat, idet der tages hensyn til de forskellige handelsdatoer.</p> <p>I tilfælde af nyordning bliver datoen for nyordningen handelsdatoen for dette derivat.</p> |
| C0230 | Varighed | <p>Derivatvarighed — defineret som den resterende modificerede varighed — for derivater, for hvilke et varighedsmål er relevant.</p> <p>Beregnet som nettovarigheden mellem ind- og udgående strømme fra derivatet, hvis det er relevant.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| C0240 | Solvens II-værdi | Derivatets værdi på indberetningsdatoen beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF. Den kan være positiv, negativ eller nul. |
| C0250 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte derivater. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver eller forpligtelser</p> <p>2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver eller forpligtelser</p> <p>3 — Alternative værdiansættelsesmetoder</p> <p>6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> |

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|---------------------|---|
| C0040 | Derivat-ID-kode | <p>Derivat-ID-kode i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0050 | Derivat-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Derivat-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> |

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|------------------|--|
| C0260 | Modpartens navn | <p>Navnet på derivatets modpart. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — navnet på børsmarkedet for børshandlede derivater eller — navnet på den centrale modpart for over the counter-derivater, hvis de cleares gennem en central modpart, eller — navnet på den kontraktmæssige modpart for de øvrige over the counter-derivater. |
| C0270 | Modpartskode | <p>Modpartens identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI, hvis tilgængelig — Kode, der tildeles af selskabet, når LEI ikke er tilgængelig; koden skal være konsistent over tid <p>Denne post gælder alle modparter, inklusive derivater, der er clearet gennem en central modpart, i hvilket tilfælde modpartskoden henviser til den pågældende centrale modpart.</p> |
| C0280 | Modpartskodetype | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Modpartskode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0290 | Ekstern rating | <p>Kun relevant for over the counter-derivater.</p> <p>Vurderingen af modparten i derivatet pr. referencedatoen for indberetningen som oplyst af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI).</p> <p>Denne post er ikke relevant for derivater, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>Hvis der ikke foreligger en udstedervurdering, udfyldes denne post ikke.</p> <p>Hvis der indberettes »Mange ECAI'er« i C0300, indberettes den mest repræsentative eksterne vurdering.</p> |
| C0300 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0290, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger udstedt af moder-ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henviser til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med forordning (EF) nr. 1060/2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <ul style="list-style-type: none"> — Denne post indberettes, når »Ekstern vurdering« (C0290) indberettes. |

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|---------------------|---|
| C0310 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt derivatets modpart, jf. artikel 109a, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de selskaber, der anvender standardformlen.</p> <p>Denne post er ikke relevant for derivater, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |
| C0320 | Intern vurdering | <p>Intern vurdering af derivater for selskaber, der bruger interne vurderinger</p> <p>For selskaber, der anvender matchtilpasning, indberettes den interne vurdering, i det omfang de interne vurderinger anvendes til beregning af det grundlæggende spread, jf. artikel 77c, stk. 2.</p> |
| C0330 | Modpartsgruppe | <p>Kun relevant for over the counter-derivater, vedrørende andre kontraktmæssige modparter end børsmarkeder og centrale modparter.</p> <p>Navnet på modpartens øverste moderselskab. Hvis enheden har et navn i databasen med Legal Entity Identifier (LEI), angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> |
| C0340 | Modpartsgruppekode | <p>Kun relevant for over the counter-derivater, vedrørende andre kontraktmæssige modparter end børsmarkeder og centrale modparter.</p> <p>Modpartens identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI, hvis tilgængelig — Kode, der tildeles af selskabet, når LEI ikke er tilgængelig; koden skal være konsistent over tid <p>Hvis den ikke finder anvendelse, indberettes denne post ikke.</p> |

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|--|--|
| C0350 | Type modpartsgruppekode | <p>Angiv, hvilken kodetype der anvendes under »Modpartsgruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0360 | Kontraktnavn | Navnet på derivatkontrakten. |
| C0370 | Valuta | ISO 4217-bogstavkoden for derivatets valuta angives, dvs. valutaen for derivatets nominelle beløb (f.eks.: mulighed for at have det underliggende beløb i USD, en valuta, for hvilke det nominelle beløb er kontraktmæssigt angivet for valutaswaps, osv.). |
| C0371 | Valuta for prisen | ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for prisen på derivatet angives, dvs. valutaen for det beløb, der veksles i forhold til derivatets nominelle værdi. For eksempel, hvis selskabet betaler (eller får) valuta A for det nominelle beløb (valuta B), så er valutaen for prisen A. Valutaen for det nominelle beløb er B, som indberettes i (C0370). |
| C0380 | CIC | Den CIC-kode, der bruges til at klassificere aktiver, jf. bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når derivater klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som derivatet er eksponeret for. |
| C0390 | Den udløsende værdi | <p>Referencepris for futures, striking-pris for optioner (for obligationer skal prisen være en procentdel af pariværdien), valutakurs eller rente for forwards osv.</p> <p>Ikke relevant for CIC D3 — Rente- og valutaswaps. Udfyldes ikke for CIC F1 — Credit default swaps, hvis det ikke er muligt.</p> <p>Hvis der over tid er mere end én den udløsende værdi, indberettes den efterfølgende udløsende værdi, der forekommer.</p> <p>Hvis et derivat har en række udløsende værdier, indberettes sættet adskilt af »«, hvis rækken ikke er fortløbende, og adskilt af »-«, hvis den er fortløbende.</p> |
| C0400 | Udløsende værdi, der fører til afvikling af kontrakten | <p>Den hændelse, der fører til afviklingen af kontrakten, ud over almindelige udløbs- eller kontraktbetingelser, anføres. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Den underliggende enheds eller referenceenhedens konkurs</p> <p>2 — Ugunstigt fald i det underliggende referenceaktives værdi</p> <p>3 — Ugunstig ændring i de underliggende aktivers eller den underliggende enheds kreditvurdering</p> <p>4 — Nyordning, dvs. det at erstatte en derivatforpligtelse med en ny forpligtelse eller at erstatte en part i en derivatkontrakt med en ny part</p> <p>5 — Mange hændelser eller en kombination af hændelser</p> <p>6 — Andre hændelser ikke omfattet af foregående valgmuligheder</p> <p>9 — Ingen udløsende værdi, der fører til afvikling</p> |

Oplysninger om derivater

| | | |
|-------|---------------|---|
| C0430 | Udløbsdato | Angiv den kontraktligt fastsatte ISO 8601-kode (åååå-mm-dd) for datoen for derivatkontraktens afslutning, hvad enten det er forfaldsdatoen, udløbsdatoen for optioner (europæiske eller amerikanske) osv. |
| C0440 | Swap, leveret | Angiv, hvad selskabet leverer i henhold til swapaftalen (f.eks. Euribor+0,5 %, 2,3 %, EUR). |
| C0450 | swap modtaget | Angiv, hvad selskabet modtager i henhold til swapaftalen (f.eks. Euribor+0,5 %, 2,3 %, EUR). |

S.09.01 — Oplysninger om gevinster/indtægter og tab i perioden*Generelle bemærkninger:*

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indeholder oplysninger om gevinster/indtægter efter aktivkategori (herunder derivater), dvs. der kræves ikke »post-for-post«-indberetning. De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier.

På koncernniveau anvendes dette skema i forbindelse med metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position af de porteføljer (dvs. med fradrag af koncerninterne transaktioner) som er omfattet af koncerntilsynet. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de porteføljer, der besiddes af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og deres datterselskaber, og deres rentabilitet efter aktivkategori. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af datterselskaber (EØS, ækvivalent ikke-EØS, ikkeækvivalent ikke-EØS), skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, skal en del af indberetningen afspejle den konsoliderede position af de porteføljer (dvs. med fradrag af koncerninterne transaktioner) som er omfattet af koncerntilsynet, og som skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de porteføljer, der besiddes af datterselskaber, og deres rentabilitet efter aktivkategori.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Den anden del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af datterselskaber (EØS, ækvivalent ikke-EØS, ikkeækvivalent ikke-EØS), skal indberettes portefølje for portefølje, hver enkelt efter aktivkategori.
- Gevinster/indtægter og tab på porteføljer, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------------|--|
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som investeringsafkastet vedrører.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om investeringsafkast efter aktivkategori for aktiver, der besiddes af datterselskaber konsolideret efter metoden med fradrag og aggregering.</p> <p>Denne celle udfyldes kun, når det drejer sig om portefølje-for-portefølje-listen over aktiver, hver enkelt indberettet efter aktivkategori, der besiddes af datterselskaber, der anvender metode 2.</p> <p>Når cellen er udfyldt, kan de porteføljer, der besiddes af datterselskaber, der anvender metode 2, ikke afstemmes med skema S.06.02.</p> <p>Når cellen er tom, kan de porteføljer, der besiddes af koncernen, afstemmes med skema S.06.02.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|---|
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Aktivkategori | <p>Angiv aktivkategorierne i porteføljen.</p> <p>Anvend de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier.</p> |
| C0050 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde.</p> <p>Gevinster/indtægter og tab for underliggende aktiver vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og gevinster/indtægter og tab for underliggende aktiver vedrørende de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Livsforsikring 2 — Skadesforsikring 3 — Ring-fenced fonde 4 — Andre interne fonde 5 — Aktiekapital 6 — Overordnet <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0060 | Aktiv i unit-linked og indeksregulerede aftaler | <p>Angiv de aktiver, der besiddes i unit-linked og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Unit-linked eller indeksreguleret</p> <p>2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret</p> |
| C0070 | Udbytte | <p>Udbytteindtægter i indberetningsperioden, dvs. modtaget udbytte minus retten til at modtage et udbytte, som allerede er indregnet ved indberetningsperiodens begyndelse, plus retten til at modtage et udbytte indregnet ved indberetningsperiodens afslutning. Relevant for udbyttebetalende aktiver som f.eks. aktier, foretrukne værdipapirer og kollektive investeringsinstitutter.</p> <p>Omfatter også udbytter modtaget fra aktiver, der er solgt eller udløbet.</p> |
| C0080 | Renter | <p>Renteindtægter, dvs. modtagne renter minus påløbne renter ved indberetningsperiodens begyndelse plus påløbne renter ved indberetningsperiodens afslutning.</p> <p>Heri medregnes modtagne renter, når aktivet sælges/udløber, eller når kuponen modtages.</p> <p>Kun relevant for aktiver med kupon- og rentebetaling som f.eks. obligationer, lån og indskud.</p> |
| C0090 | Leje | <p>Lejeindtægter, dvs. modtaget leje minus optjent leje ved indberetningsperiodens begyndelse plus optjent leje ved indberetningsperiodens afslutning.</p> <p>Heri medregnes også modtaget leje, når aktivet sælges eller afhændes.</p> <p>Kun relevant for ejendomme uanset funktion.</p> |
| C0100 | Nettogevinster og -tab | <p>Nettogevinster og -tab hidrørende fra aktiver, der er solgt eller udløbet i løbet af indberetningsperioden.</p> <p>Gevinster og tab beregnes som forskellen mellem værdi ved salg eller udløb og værdien i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af det foregående indberetningsår (eller for aktiver, der er erhvervet i løbet af indberetningsperioden, anskaffelsesværdien).</p> <p>Nettoværdien kan være positiv, negativ eller nul.</p> <p>Beregningen skal foretages uden påløbne renter.</p> |
| C0110 | Urealiserede gevinster og tab | <p>Urealiserede gevinster og tab hidrørende fra aktiver, der ikke er solgt eller udløbet i løbet af indberetningsperioden.</p> <p>De urealiserede gevinster og tab beregnes som forskellen mellem værdi i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af indberetningsåret og værdi i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF ved udgangen af det foregående indberetningsår (eller for aktiver, der er erhvervet i løbet af indberetningsperioden, anskaffelsesværdien).</p> <p>Nettoværdien kan være positiv, negativ eller nul.</p> <p>Beregningen skal foretages uden påløbne renter.</p> |

S.10.01 — Værdipapirudlån og -genkøb

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over transaktioner med udlån af værdipapirer og genkøbsaftaler (køber og sælger), hvilket også omfatter likviditetsswaps som omhandlet i artikel 309, stk. 2, litra f), i delegeret forordning (EU) 2015/35.

Det indgives kun, når værdien af de underliggende balanceførte og ikkebalanceførte værdipapirer i udlåns- eller genkøbsaftaler med en forfaldsdato efter referencedatoen for indberetningen udgør mere end 5 % af de samlede investeringer indberettet under post C0010/R0070 og C0010/R0220 i skema S.02.01, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes alene. Når metode 1 anvendes sammen med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2 anvendes alene, skal andelen justeres for at afspejle posterne hos alle enheder, der er omfattet af skema S.06.02.

Alle kontrakter, der er balanceført eller ikkebalanceført, skal indberettes. Oplysningerne skal omfatte alle kontrakter i indberetningsperioden, uanset om de var åbne eller afsluttede på indberetningsdatoen. For så vidt angår kontrakter, der er del i en rollover-strategi, hvor de i vidt omfang udgør samme transaktion, indberettes kun åbne positioner.

En genkøbsaftale (repo) defineres som salg af værdipapirer ledsaget af en aftale om sælgers tilbagekøb af værdipapirerne på et senere tidspunkt. Værdipapirudlån defineres som udlån af værdipapirer fra en part til en anden, hvilket kræver, at låntageren stiller sikkerhed over for långiveren.

Poster skal indberettes med positive værdier, medmindre andet er angivet i de pågældende vejledninger.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Hver genkøbs- og værdipapirudlånskontrakt skal indberettes i så mange rækker som nødvendigt for at fremlægge de ønskede oplysninger. Hvis der for én post, er én option, der passer til den ene del af det indberettede instrument, og en anden option, der passer til den anden del, så skal kontrakten opsplittes, medmindre andet er fastsat i vejledningen.

Dette skema anvendes i forbindelse med metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position for genkøbs- og værdipapirudlånskontrakterne — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne eller de blandede finansielle holdingselskaber og deres datterselskaber, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, skal en del af indberetningen afspejle den konsoliderede position af de genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet, og som skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og deres datterselskaber, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Den anden del af indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden), af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, der anvender metode 2, skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber, der anvender metode 2 (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post.
- De genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af andre tilknyttede selskaber, der anvender metode 2, medregnes ikke.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder genkøbs- og værdipapirudlånskontrakten.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om genkøbs- og værdipapirudlånskontrakter, der besiddes af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, der anvender metoden med fradrag og aggregering.</p> |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0040 | Portefølje | <p>Sondring mellem livsforsikring, skadesforsikring, aktiekapital, overordnet (ingen opdeling) og ring-fenced fonde. Underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikring tildeles porteføljen for livsforsikring, og underliggende aktiver for de forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikring tildeles porteføljen for skadesforsikring (ved at anvende den mest nøjagtige opdeling, der er til rådighed).</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Livsforsikring</p> <p>2 — Skadesforsikring</p> <p>3 — Ring-fenced fonde</p> <p>4 — Andre interne fonde</p> <p>5 — Aktiekapital</p> <p>6 — Overordnet</p> <p>Denne opdeling er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed, bortset fra identifikationen af ring fenced fonde, men den skal indberettes, hvis selskabet anvender den internt. Når et selskab ikke anvender en opdeling, skal »overordnet« anvendes.</p> <p>For aktiver, der ikke balanceføres, indberettes denne post ikke.</p> |
| C0050 | Fondsnummer | <p>Gælder for aktiver i ring fenced fonde eller andre interne fonde, defineret i henhold til nationale markeder, især hvad angår fonde (aktivporteføljer) til støtte for livsforsikringsprodukter.</p> <p>Nummer eller kode, der tildeles af selskabet, og som svarer til det unikke nummer eller den unikke kode, der tildeles hver fond. Nummeret eller koden skal være konsistent over tid og skal anvendes til at identificere de samme fonde i andre skemaer (f.eks. i S.06.02). Det må ikke genanvendes til en anden fond.</p> <p>Fondsnummeret er ikke obligatorisk, medmindre det kræves af den nationale tilsynsmyndighed.</p> |
| C0060 | Aktivkategori | <p>Angiv aktivkategorierne for det underliggende aktiv, der er udlånt/stillet som sikkerhed i forbindelse med transaktioner med udlån af værdipapirer eller genkøbsaftaler.</p> <p>Anvend de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0070 | Modpartens navn | Navnet på kontraktens modpart Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn. |
| C0080 | Modpartskode | Angiv identifikationskoden for modparten ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke. |
| C0090 | Modpartskodetype | Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Modpartskode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 9 — Ingen |
| C0100 | Kategori for modpartens aktiv | Angiv den vigtigste aktivkategori, der er lånt/modtaget i forbindelse med transaktioner med udlån af værdipapirer eller genkøbsaftaler. Anvend de aktivkategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning. |
| C0110 | Aktiver, der besiddes i forbindelse med unit-linked aftaler og indeksregulerede aftaler | Angiv, om det underliggende aktiv defineret i C0060 besiddes i forbindelse med unit-linked aftaler og indeksregulerede aftaler. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Unit-linked eller indeksreguleret 2 — Hverken unit-linked eller indeksreguleret |
| C0120 | Position i kontrakten | Angiv, om selskabet er køber eller sælger i genkøbsaftalen eller långiver eller låntager i værdipapirudlånsaftalen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Køber i en repo 2 — Sælger i en repo 3 — Långiver i en værdipapirudlånsaftale 4 — Låntager i en værdipapirudlånsaftale |
| C0130 | Near leg-beløb | Repræsenterer følgende beløb: — Køber i en repo: modtaget beløb ved aftalens indgåelse — Sælger i en repo: cederet beløb ved aftalens indgåelse — Långiver i en værdipapirudlånsaftale modtaget beløb som garanti ved aftalens indgåelse — Låntager i en værdipapirudlånsaftale beløb eller markedsværdi af værdipapirer modtaget ved aftalens indgåelse |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|--|
| C0140 | Far leg-beløb | Denne post er kun relevant for genkøbsaftaler og præsenterer følgende beløb: — Køber i en repo: cederet beløb ved aftalens udløb — Sælger i en repo: modtaget beløb ved aftalens udløb |
| C0150 | Startdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for kontraktens startdato. Kontraktens startdato refererer til den dato, på hvilken forpligtelserne i henhold til kontrakten får virkning. |
| C0160 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for kontraktens slutdato. Selv om aftalen er uden fast løbetid, udløber den normalt på en bestemt dato. I disse tilfælde skal denne dato indberettes, hvis der ikke forekommer en opsigelse inden da. En aftale anses for afsluttet, når den er udløbet, når den er opsagt, eller når den annulleres. For kontrakter uden fastsat forfaldsdato angives »9999-12-31«. |
| C0170 | Solvens II-værdi | Denne post er kun relevant for kontrakter, som stadig er åbne på indberetningsdatoen. Værdi af genkøbs- eller værdipapirudlånskontrakten i henhold til bestemmelserne i artikel 75 i direktiv 2009/138/EF om værdiansættelse af kontrakter. Denne værdi kan være positiv, negativ eller nul. |

S.11.01 — Aktiver, der besiddes som sikkerhed

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema skal indberettes årligt, når andelen af de aktiver, der besiddes som sikkerhed, i forhold til den samlede balance overstiger 10 %.

En aktiepulje, som sikrer investeringen (f.eks. den aktiepulje, der er sikkerhed for dækkede obligationer), indberettes ikke i dette skema. Den sikkerhedsstillelse, der dækker tilgodehavender fra genforsikring, indberettes i skema S.11.01.

Skemaet indeholder en post-for-post-liste over ikkebalanceførte aktiver, der besiddes som sikkerhed for balancen ved udgangen af indberetningsperioden. Ved sikkerhed »der besiddes« forstår, når selskaberne, der er omfattet af ovenfor beskrevne anvendelsesområde, eller ét af de selskaber, der indgår i koncernen, har »ret til direkte adgang til sikkerheden«, således at der er givet tilsagn om sikkerheden til enheden, og at den kan identificeres enkeltvis.

Det indeholder detaljerede oplysninger hvad angår aktiver, der besiddes som sikkerhed, og ikke hvad angår aftalen om sikkerhedsstillelse.

Hvis der findes en sikkerhedsstillelsepulje eller en aftale om sikkerhedsstillelse, der omfatter mange aktiver, indberettes lige så mange rækker, som der er aktiver i puljen eller aftalen.

Skemaet indeholder to tabeller: Oplysninger om positioner, der besiddes, og oplysninger om aktiver.

I tabellen »Oplysninger om positioner« skal hvert aktiv, der besiddes som sikkerhed, indberettes særskilt i så mange rækker som nødvendigt for at udfylde alle de påkrævede variabler i tabellen. Hvis der for det samme aktiv kan tilskrives to værdier til én variabel, skal det pågældende aktiv indberettes i mere end én række. »Fast ejendom, der besiddes som sikkerhed for realkreditlån til fysiske personer, skal indberettes i én række.

I tabellen »Oplysninger om aktiver« skal hvert aktiv, der besiddes som sikkerhed, indberettes særskilt, med én række for hvert aktiv, så alle relevante påkrævede variabler udfyldes i tabellen.

Alle poster undtagen »Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes« (C0140), »Navn på den modpart, der stiller sikkerheden« (C0060) og »Navn på den modpartsgruppe, der stiller sikkerheden« (C0070) vedrører oplysninger om aktiver, der besiddes som sikkerhed. Post C0140 vedrører det balanceførte aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes, mens post C0060 og C0070 vedrører den modpart, der stiller sikkerheden.

De i dette skema omhandlede aktivkategorier er de kategorier, der er defineret i bilag IV — Aktivkategorier til denne forordning, og henvisninger til CIC-koder (supplerende identifikationskoder) henviser til bilag VI — CIC-tabel til denne forordning.

Skema S.11.01 indeholder de ikkebalanceførte aktiver, der besiddes som sikkerhed for balanceførte aktiver, som besiddes direkte af selskabet, og disse værdier skal ret beset også indberettes i S.03.01 i C0020/R0100 til R0130.

Dette skema anvendes i forbindelse med metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), metode 2 (metode med fradrag og aggregering) og en kombination af metode 1 og 2.

Når metode 1 anvendes alene, skal indberetningen afspejle den konsoliderede position af de aktiver, der besiddes som sikkerhed, og som er omfattet af koncerntilsynet — med fradrag af koncerntinterne transaktioner. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.
- De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes som sikkerhed af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når metode 2 anvendes alene, skal indberetningen indeholde den detaljerede liste over de aktiver, der besiddes som sikkerhed af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaberne og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes. Indberetningen skal foretages som følger:

- Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.
- De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, der anvender metode 2, skal indberettes post for post.
- De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af forsikrings- og genforsikringsselskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post.

— De aktiver, der besiddes som sikkerhed af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Når der anvendes en kombination af metode 1 og 2, skal en del af indberetningen afspejle den konsoliderede position af de aktiver, der besiddes som sikkerhed — med fradrag af koncerninterne transaktioner — som er omfattet af koncerntilsynet, og som skal indberettes, og den anden del af indberetningen skal indeholde den detaljerede liste over de aktiver, besiddes som sikkerhed af de deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaberne, uanset hvilken forholdsmæssig andel der anvendes.

Den første del af indberetningen skal foretages som følger:

— Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« indberettes ikke.

— De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.

— De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, skal indberettes post for post.

— De aktiver, der besiddes som sikkerhed af andre tilknyttede selskaber, medregnes ikke.

Den anden del af indberetningen skal foretages som følger:

— Posten »Registreret navn på selskab — C0010« og »Identifikationskode for selskab — C0020« skal indberettes.

— De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af deltagende forsikrings- og genforsikringsselskaber eller forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, skal indberettes post for post.

— De aktiver, der besiddes direkte (dvs. ikke efter se-igennem-metoden) som sikkerhed af forsikrings- og genforsikrings-selskaber, forsikringsholdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er, der er datterselskaber og anvender metode 2 (EØS, ækvivalente ikke-EØS og ikkeækvivalente ikke-EØS), skal indberettes post for post.

— De aktiver, der besiddes som sikkerhed af andre tilknyttede selskaber, der anvender metode 2, medregnes ikke.

| | POST | VEJLEDNING |
|---|-----------------------------|--|
| Oplysninger om positioner, der besiddes | | |
| C0010 | Registreret navn på selskab | <p>Angiv det registrerede navn på det selskab, der er omfattet af koncerntilsynet, og som besidder aktivet som sikkerhed.</p> <p>Denne post udfyldes kun, når det drejer sig om aktiver, der besiddes som sikkerhed af deltagende selskaber, forsikringsholdingselskaber, blandede finansielle holdingselskaber og datterselskaber, der anvender metoden med fradrag og aggregering.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0060 | Navnet på den sikkerhedsstillende modpart | <p>Navnet på den modpart, der stiller sikkerheden. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Hvis det balanceførte aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes, er policelån, indberettes »Forsikringstager«.</p> |
| C0070 | Navnet på den sikkerhedsstillende modpartsgruppe | <p>Angiv den økonomiske modpartsgruppe, der stiller sikkerheden. Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis der ikke findes et sådant navn, angives det registrerede navn.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis de balanceførte aktiver, for hvilke sikkerheden besiddes, er policelån.</p> |
| C0080 | Deponeringsland | <p>»ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor selskabet har deponerede aktiver. Med henblik på identificering af internationale depositarer, som f.eks. Euroclear, er deponeringslandet det land, hvor der er indgået aftale om deponering.</p> <p>Hvis det samme aktiv er deponeret i mere end ét land, skal hvert aktiv indberettes særskilt i så mange rækker, som det er nødvendigt for på behørig vis at angive alle deponeringslande.</p> <p>Denne post er ikke relevant for sikkerhed i CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, CIC 71, CIC 75 og for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver.</p> <p>Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), fastslås udstederlandet ud fra ejendommens adresse.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| C0090 | Mængde | <p>Antal aktiver, for alle aktiver, hvor det er relevant.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Pariværdi« (C0100) indberettes.</p> |
| C0100 | Pariværdi | <p>Udestående beløb målt til pariværdi, for alle aktiver, hvor denne post er relevant, og til nominal værdi for CIC = 72, 73, 74, 75, 79 og 8. Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 71 og 9. Denne post indberettes ikke, hvis posten »Mængde« (C0090) indberettes.</p> |
| C0110 | Vurderingsmetode | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at værdiansætte aktiver. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Officiel markedskurs på aktive markeder for de samme aktiver</p> <p>2 — Officiel markedskurs på aktive markeder for lignende aktiver</p> <p>3 — Alternative værdiansættelsesmetoder</p> <p>4 — Justeret indre værdis metode (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>5 — Indre værdis metode i henhold til IFRS (relevant for værdiansættelsen af kapitalinteresser)</p> <p>6 — Markedsværdiansættelse i henhold til artikel 9, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> |
| C0120 | Samlet beløb | <p>Værdi beregnet som fastsat ved artikel 75 i direktiv 2009/138/EF, svarende til:</p> <ul style="list-style-type: none"> — »Pariværdi« (udestående hovedstol målt til pariværdi eller nominal værdi) ganget med »Procentsats af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« plus »Påløbne renter«, for aktiver, hvor de første to poster er relevante — »Mængde« ganget med »Solvens II-pris pr. enhed«, for aktiver, hvor disse to poster er relevante — Solvens II-værdien af aktiverne for aktiver, der kan klassificeres under aktivkategori 71 og 9. |
| C0130 | Påløbne renter | <p>Angiv beløbet for påløbne renter efter den sidste kupondato for rentebærende værdipapirer. Bemærk, at denne værdi også er en del af posten »Samlet beløb«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------|--|---|
| C0140 | Type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes | <p>Angiv type aktiv, for hvilket sikkerheden besiddes.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Statsobligationer</p> <p>2 — Erhvervsobligationer</p> <p>3 — Egenkapital</p> <p>4 — Kollektive investeringsinstitutter</p> <p>5 — Strukturerede værdipapirer</p> <p>6 — Sikrede værdipapirer</p> <p>7 — Kontanter og indskud</p> <p>8 — Lån, herunder realkreditlån</p> <p>9 — Ejendomme</p> <p>0 — Øvrige investeringer (herunder tilgodehavender)</p> <p>X — Derivater</p> <p>F.eks. vælges »0 — Øvrige investeringer« for den sikkerhedsstillelse, der dækker tilgodehavender fra genforsikring.</p> |
| | POST | VEJLEDNING |
| Oplysninger om aktiver | | |
| C0040 | Aktiv-ID-kode | <p>Aktiv-ID-kode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i to eller flere valutaer, er det nødvendigt at angive aktiv-ID-koden og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, som i følgende eksempel: »kode + EUR«.</p> |
| C0050 | Aktiv-ID-kodetype | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-----------------------|--|
| | | <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet</p> <p>Når den samme aktiv-ID-kode skal indberettes for et aktiv, der er udstedt i 2 eller flere valutaer, og koden i C0040 er defineret ved aktiv-ID-kode og ISO 4217-bogstavkoden for valutaen, skal aktiv-ID-koden henvise til valgmulighed 99 og valgmuligheden for den oprindelige aktiv-ID-kode som i følgende eksempel, hvor den indberettede kode var ISIN-kode + valuta: »99/1«.</p> |
| C0150 | Betegnelse for posten | <p>Angiv den indberettede post ved at videregive de af selskabet fastsatte oplysninger om navnet på aktivet (eller adresse, hvis det drejer sig om ejendom).</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, skal denne post, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter dens art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres. Lån til andre end fysiske personer indberettes række for række. — Denne post er ikke relevant for CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres, eller for CIC 71 og CIC 75. — Hvis sikkerhedsstillelsen omfatter forsikringspolicer (vedrørende lån med sikkerhedsstillelse i forsikringspolicer), er det ikke nødvendigt, at disse policer individualiseres, og denne post er ikke relevant. — For ejendomme indberettes ISO-landekoden alpha-2 + postnummer + by + gade-adenavn + husnummer) for den ejendom, der besiddes, eller den bredde- og længdegrad eller den CRESTA-/NUTS-region, hvor ejendomsinvesteringen finder sted: administrative grænser (f.eks. provins- eller distriktsgrænse f.eks. NUTS3-niveau) eller sammenlagte postkodeområder (f.eks. de første to tal er postkodeområder, i lighed med de såkaldte »low resolution zones« i CRESTA (Catastrophe Risk Evaluation and Standardising TARGET Accumulations) 2019[2]). |
| C0160 | Udsteders navn | <p>Navnet på udstederen, som er defineret som den enhed, der udsteder aktiver, som repræsenterer en del af dens kapital, en del af dens gæld, derivater osv., til investorer.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederens navn navnet på fondsforvalteren. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| | | <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederens navn navnet på depositaren.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, skal denne post, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, indeholde »Lån til AMSB-medlemmer« eller »Lån til andre fysiske personer«, alt efter deres art, da sådanne aktiver ikke skal individualiseres.</p> <p>— Hvad angår CIC 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0170 | Udstederkode | <p>Angiv identifikationskoden for udstederen ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstederkoden koden for fondsforvalteren.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75), er udstederkoden koden for depositaren.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> |
| C0180 | udstederkodetype | <p>Angiv, hvilken udstederkode der anvendes under »Udstederkode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0190 | Udstedersektor | <p>Angiv udstederens økonomiske sektor på grundlag den seneste udgave af NACE-koderne (som offentliggjort i en EF-forordning). For NACE-hovedafdelinger A til N kræves der ved fuld indberetning firecifrede NACE-koder, dvs. bogstavet for hovedafdelingen, efterfulgt af den firecifrede kode for kategorien (f.eks. »K6411«). For de resterende hovedafdelinger anvendes bogstavreferencen i NACE-koden, hvorved hovedafdelingen identificeres, som et minimum til identifikation af sektorer (f.eks. ville »P« eller »P8501« kunne godtages).</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|---|
| | | <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter, er udstedersektoren den sektor, som fondsforvalteren tilhører. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstedersektoren den sektor, som depositaren tilhører. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, skal oplysningerne vedrøre låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer. |
| C0200 | Udstedergruppenavn | <p>Navnet på udstederens øverste moderselskab.</p> <p>Hvis enheden har et navn i LEI-databasen, angives dette navn under denne post. Hvis det ikke findes, angives det registrerede navn.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter henfører grupperelationen til fondsforvalteren. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. — Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, henfører grupperelationen til låntageren. — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer). <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0210 | Udstedergruppekode | <p>Angiv udstedergruppens identifikationskode ved hjælp af LEI, hvis denne findes.</p> <p>Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter henfører grupperelationen til fondsforvalteren. — Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) henfører grupperelationen til depositaren. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| | | <p>— Hvad angår CIC 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, henfører grupperelationen til låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer).</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0220 | Type udstedergruppekode | <p>Angiv, hvilken type kode der anvendes under »Udstedergruppekode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>9 — Ingen</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, hvis det drejer sig om lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer.</p> <p>Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> |
| C0230 | Udstederland | <p>ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor udstederen befinder sig.</p> <p>Udstederens lokalisering fastslås ud fra adressen på den enhed, der udsteder aktivet.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 4 — Kollektive investeringsinstitutter er udstederlandet fondsforvalterens land.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 7 — Kontanter og indskud (undtagen CIC 71 og CIC 75) er udstederlandet depositarens land.</p> <p>— Hvad angår CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån, bortset fra CIC 87 og CIC 88, skal oplysningerne vedrøre låntageren.</p> <p>— Denne post er ikke relevant for CIC 71, CIC 75, CIC 09 og CIC-kategori 9 — Ejendom.</p> <p>En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>— ISO 3166-1 alpha-2-kode</p> <p>— XA: Supranationale udstedere</p> <p>— EU: Den Europæiske Unions institutioner</p> |
| C0240 | Valuta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen.</p> <p>Følgende tages i betragtning:</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Denne post er ikke relevant for CIC-kategori 8 — Lån, herunder realkreditlån (for lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer, da det ikke kræves, at sådanne aktiver skal individualiseres), CIC 75 og CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug) af samme grund. — Hvad angår CIC-kategori 9, undtagen CIC 95 — Materielle anlægsaktiver (til eget brug), svarer valuta til den valuta, som investeringen blev foretaget i. |
| C0250 | CIC | Den CIC-kode, der bruges til at klassificere aktiver, jf. bilag VI — CIC-tabel til denne forordning. Når et aktiv klassificeres ved hjælp af CIC-tabellen, skal selskaber tage hensyn til den mest repræsentative risiko, som aktivet er eksponeret for. |
| C0260 | Pris pr. enhed | <p>Pris pr. enhed for aktivet, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed« (C0270) indberettes.</p> |
| C0270 | Procentdel af pariværdi af Solvens II-pris pr. enhed | <p>Aktivets værdi i procent af pariværdi, »clean price« uden påløbne renter, hvis det er relevant.</p> <p>Denne post skal indberettes, hvis en »pariværdi« (C0100) er oplyst i den første del af skemaet (»Oplysninger om positioner, der besiddes«), undtagen for CIC-kategori 71 og 9.</p> <p>Denne post indberettes ikke, hvis posten »Solvens II-pris pr. enhed« (C0260) indberettes.</p> |
| C0280 | Udløbsdato | <p>Kun relevant for CIC-kategori 1, 2, 5, 6 og 8 samt CIC 74 og CIC 79.</p> <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for forfaldsdatoen.</p> <p>Svarer altid til forfaldsdatoen, selv for værdipapirer, som kan kræves indkaldt. Følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For værdipapirer uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«. — For CIC-kategori 8 vedrørende lån, herunder realkreditlån, til fysiske personer indberettes den vægtede (på basis af lånebeløbet) restløbetid. |

S.22.01 — Virkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema anvendes, når mindst én langsigtet garanti eller overgangsforanstaltning anvendes af et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn.

Formålet med dette skema er at give et billede af virkningen på den finansielle stilling, når der ikke anvendes overgangsforanstaltninger, og hver langsigtet garanti eller overgangsforanstaltning sættes til nul. Med henblik herpå bør der anvendes en trinvis metode, hvor hver overgangsforanstaltning og langsigtet garanti tages en efter en, og uden at omberegne virkningen af de resterende foranstaltninger efter hvert trin. Eftersom det er muligt, at begge typer overgangsforanstaltninger anvendes inden for en koncern, følger skemaet en kumulativ trinvis metode.

Virkningerne skal indberettes som positive, hvis de øger størrelsen af den indberettede post, og negative, hvis de reducerer postens størrelse (hvis f.eks. solvenskapitalkravet stiger, eller hvis kapitalgrundlaget stiger, så indberettes der positive værdier).

I de beløb, der indberettes i dette skema, medregnes ikke koncerninterne transaktioner.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0010 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, inklusive langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0010 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0010 | Virkning af overgangsforanstaltninger på forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justering af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0010 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0010 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den risikofrie rentekurve og de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0060/R0010 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af eventuelle justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0010 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Forsikringsmæssige hensættelser | beløbet for justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det største af de beløb for de forsikringsmæssige hensættelser, der er indberettet under C0010, C0020 og C0040. |
| C0080/R0010 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Forsikringsmæssige hensættelser | Forsikringsmæssige bruttohensættelser i alt uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0010 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justeringen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det største af de beløb for de forsikringsmæssige hensættelser, der er indberettet under C0010, C0020, C0040 og C0060. |
| C0100/R0010 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Forsikringsmæssige hensættelser | Den del af justering af de forsikringsmæssige bruttohensættelser, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0020 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0020 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag | Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0030/R0020 | Virkning af overgangsforanstaltninger på forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag | <p>Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.»</p> |
| C0040/R0020 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag | <p>Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0020 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesats — Basiskapitalgrundlag | <p>Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0020 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | <p>Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0020 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag | <p>Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0020 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag | <p>Basiskapitalgrundlag i alt beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0090/R0020 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. »Det er forskellen mellem basiskapitalgrundlaget beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og basiskapitalgrundlaget beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0020 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag | Den del af justeringen af basiskapitalgrundlaget, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0030 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0030 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0030 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Den del af justeringen af de overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0030 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0050/R0030 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0030 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>De samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0030 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0030 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Samlede overskydende aktiver i forhold til passiver, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |
| C0090/R0030 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og overskydende aktiver i forhold til passiver beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0030 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Overskydende aktiver i forhold til passiver | <p>Den del af justeringen af overskydende aktiver i forhold til passiver, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0040 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basis-kapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0040 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basis-kapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningsjusteringen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0040 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Basis-kapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0040 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0040 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0040 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0070/R0040 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | <p>Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0040 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | <p>Begrænset kapitalgrundlag i alt som følge af ring-fencing, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |
| C0090/R0040 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | <p>Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0040 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Basiskapitalgrundlag — Begrænset kapitalgrundlag som følge af ring-fencing og matchningsportefølje | Den del af justeringen af det begrænsede kapitalgrundlag som følge af ring-fencing, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0050 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0050 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0030/R0050 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0050 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0050 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>»Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0050 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0050 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0050 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0090/R0050 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0050 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0060 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0060 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |
| C0030/R0060 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0060 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0050/R0060 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0060 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0060 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0060 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |
| C0090/R0060 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0060 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for kernekapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010/R0070 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0070 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010. |
| C0030/R0070 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0040/R0070 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen. Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020. |
| C0050/R0070 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve. Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020. |
| C0060/R0070 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0070/R0070 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0070 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |
| C0090/R0070 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>»Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0070 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0080 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0080 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0030/R0080 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0080 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0080 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |
| C0060/R0080 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen.</p> <p>Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040.</p> |
| C0070/R0080 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul.</p> <p>»Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040.</p> |
| C0080/R0080 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier.</p> <p>Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0090/R0080 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | <p>Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul.</p> <p>Det er forskellen mellem det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060.</p> |
| C0100/R0080 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital | Den del af justeringen af det anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet for resterende supplerende kapital, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010/R0090 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, inklusive justeringerne som følge af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0020/R0090 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Solvenskapitalkrav | <p>Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser, uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0010.</p> |
| C0030/R0090 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Solvenskapitalkrav | <p>Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsfradrag i de forsikringsmæssige hensættelser og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger.</p> |
| C0040/R0090 | Uden overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Solvenskapitalkrav | <p>Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve, men med bibeholdelse af justeringer som følge af volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen.</p> <p>Hvis overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0020.</p> |
| C0050/R0090 | Virkning af overgangsforanstaltninger vedrørende rentesatsen — Solvenskapitalkrav | <p>Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af overgangsjusteringen på den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden overgangsjustering af den relevante risikofrie rentekurve og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0020.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0060/R0090 | Uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden justering som følge af overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser, overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve og volatilitetsjusteringen, men med bibeholdelse af justeringer som følge af matchtilpasningen. Hvis volatilitetsjusteringen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0040. |
| C0070/R0090 | Virkning af volatilitetsjustering sat til nul — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af volatilitetsjusteringen. Den skal afspejle virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen til nul. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden volatilitetsjustering og uden andre overgangsforanstaltninger og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0040. |
| C0080/R0090 | Uden matchtilpasning og uden alle de andre — Solvenskapitalkrav | Samlet solvenskapitalkrav beregnet under hensyn til forsikringsmæssige hensættelser uden langsigtede garantier. Hvis matchtilpasningen ikke finder anvendelse, indberettes den samme værdi som i C0060. |
| C0090/R0090 | Virkning af matchtilpasning sat til nul — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af matchtilpasningen. Heri medregnes virkningen af at sætte volatilitetsjusteringen og matchtilpasningen til nul. Det er forskellen mellem solvenskapitalkravet beregnet under hensyn til de forsikringsmæssige hensættelser uden matchtilpasning og uden alle de andre overgangsforanstaltninger og solvenskapitalkravet beregnet med de forsikringsmæssige hensættelser indberettet i C0060. |
| C0100/R0090 | Virkning af alle langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkrav | Den del af justeringen af solvenskapitalkravet, der skyldes anvendelsen af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger. |
| C0010-C0100/R0120 | Med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Solvenskapitalkravsprocent | Solvenskapitalkravsprocenten beregnes under hensyntagen til de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0010 i hver kolonne. Det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af solvenskapitalkravet (R0050) divideret med det samlede solvenskapitalkrav (R0090) i hver kolonne. |
| C0010-C0100/R0130 | Beløb med langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger — Minimumskapitalkravsprocent | Minimumskapitalkravsprocenten beregnes under hensyntagen til de forsikringsmæssige hensættelser som indberettet i R0010 i hver kolonne. Det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af minimumskapitalkravet (R0100) divideret med det samlede minimumskapitalkrav (R0110) i hver kolonne. |

S.23.01 — Kapitalgrundlag

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den kvartalsvise og årlige indberetning for koncerner.

Skemaet anvendes for alle tre beregningsmetoder vedrørende koncernsolvenskapitalkravet. Da de fleste poster vedrører den del af koncernen, der er omfattet af metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering), er de poster, der er relevante, når metode 2 (metode med fradrag og aggregering) anvendes, udelukkende eller i kombination med metode 1, klart angivet i vejledningen.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Basiskapitalgrundlag før fradrag af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer

| | | |
|-------------|--|---|
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — I alt | Den samlede stamaktiekapital, som besiddes direkte og indirekte (før fradrag af egne aktier). Den samlede stamaktiekapital på koncernniveau, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer. Eventuel stamaktiekapital, som ikke fuldt ud opfylder kriterierne, behandles som præferenceaktiekapital og klassificeres i overensstemmelse hermed, uanset hvordan den beskrives eller betegnes. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — kernekapital ubegrænset | Indbetalt stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital. |
| R0010/C0040 | Stamaktiekapital (uden fradrag af egne aktier) — supplerende kapital | Indkaldt stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0020/C0010 | Ikke til rådighed stående, indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0020/C0020 | Ikke til rådighed stående, indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital ubegrænset | Indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0020/C0040 | Ikke til rådighed stående, indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Indkaldt, men ikke indbetalt stamaktiekapital, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0030/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt | Den samlede overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0030/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital ubegrænset | Overkurs ved emission vedrørende stamaktier, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital, fordi den vedrører stamaktiekapital, som behandles som ubegrænset kernekapital. |
| R0030/C0040 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende stamaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapital, fordi den vedrører stamaktiekapital, som behandles som supplerende kapital. |
| R0040/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — I alt | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som fuldt ud opfylder kriterierne for kernekapitalelementer eller supplerende kapitalelementer. |
| R0040/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Kernekapital ubegrænset | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital |
| R0040/C0040 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — supplerende kapital | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0050/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — I alt | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt, som fuldt ud opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer, supplerende kapitalelementer eller resterende supplerende kapitalelementer. |
| R0050/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital begrænset | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital. |
| R0050/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0050/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0060/C0010 | Ikke til rådighed stående, efterstillede gensidige medlemskonti, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Efterstillede gensidige medlemskonti, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0060/C0030 | Ikke til rådighed stående, efterstillede gensidige medlemskonti, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital begrænset | Efterstillede gensidige medlemskonti, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0060/C0040 | Ikke til rådighed stående, efterstillede gensidige medlemskonti, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0060/C0050 | Ikke til rådighed stående, efterstillede gensidige medlemskonti, der skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Efterstillede gensidige medlemskonti, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0070/C0010 | Overskudskapital — I alt | Den samlede overskudskapital, der hører ind under artikel 91, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0070/C0020 | Overskudskapital — kernekapital ubegrænset | Den overskudskapital, jf. artikel 91, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0080/C0010 | Ikke til rådighed stående overskudskapital, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Overskudskapital, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0080/C0020 | Ikke til rådighed stående overskudskapital, som skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital ubegrænset | Overskudskapital, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0090/C0010 | Præferenceaktier — I alt | Præferenceaktier i alt udstedt af selskabet, som fuldt ud opfylder kriterierne for elementer af begrænset kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital. |
| R0090/C0030 | Præferenceaktier — kernekapital begrænset | Udstedte præferenceaktier, som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital. |
| R0090/C0040 | Præferenceaktier — supplerende kapital | Præferenceaktier udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0090/C0050 | Præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Præferenceaktier udstedt af selskabet, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0100/C0010 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0100/C0030 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital begrænset | Præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0100/C0040 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0100/C0050 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier, der skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0110/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt | Den samlede overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som fuldt ud opfylder kriterierne for elementer af begrænset kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital. |
| R0110/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital begrænset | Værdi af overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0110/C0040 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapital, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som supplerende kapital. |
| R0110/C0050 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, fordi den vedrører præferenceaktier, som behandles som resterende supplerende kapital. |
| R0120/C0010 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Overkurs ved emission i alt vedrørende præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0120/C0030 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital begrænset | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0120/C0040 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0120/C0050 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0130/C0010 | Afstemningsreserve — I alt | Den samlede afstemningsreserve består af reserver (f.eks. overført resultat) med fradrag af justeringer (f.eks. ring-fenced fonde). Den skyldes hovedsagelig forskelle mellem regnskabsmæssig værdiansættelse og værdiansættelse i henhold til artikel 75 i direktiv 2009/138/EF. |
| R0130/C0020 | Afstemningsreserve — kernekapital ubegrænset | Afstemningsreserven består af reserver (f.eks. overført resultat) med fradrag af justeringer (f.eks. ring-fenced fonde). Den skyldes hovedsagelig forskelle mellem regnskabsmæssig værdiansættelse og værdiansættelse i henhold til direktiv 2009/138/EF. |
| R0140/C0010 | Efterstillet gæld — I alt | Den samlede efterstillede gæld. |
| R0140/C0030 | Efterstillet gæld — kernekapital begrænset | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0140/C0040 | Efterstillet gæld — supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0140/C0050 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0150/C0010 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Efterstillet gæld i alt, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0150/C0030 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital begrænset | Efterstillet gæld, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0150/C0040 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Efterstillet gæld, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0150/C0050 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld, der skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Efterstillet gæld, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0160/C0010 | Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto — I alt | Det samlede beløb for udskudte skatteaktiver netto. |
| R0160/C0050 | Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver netto — resterende supplerende kapital | Beløbet for udskudte skatteaktiver netto, som opfylder klassifikationskriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0170/C0010 | Et beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto, som skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Udskudte skatteaktiver netto, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0170/C0050 | Et beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto, som skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Udskudte skatteaktiver, opgjort netto, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0180/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. | Summen af ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0020 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital ubegrænset | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0180/C0030 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital begrænset | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0040 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for supplerende kapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0180/C0050 | Andre, ikke ovenfor angivne kapitalgrundlagselementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital | Ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og er godkendt af tilsynsmyndigheden. |
| R0190/C0010 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndigheden, der skal fratrækkes — I alt | Kapitalgrundlagselementer i alt vedrørende andre ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0190/C0020 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndigheden, der skal fratrækkes — ubegrænsede kernekapitalelementer | Kapitalgrundlagselementer vedrørende andre ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0190/C0030 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndigheden, der skal fratrækkes — begrænsede kernekapitalelementer | Kapitalgrundlagselementer vedrørende andre ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0190/C0040 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndigheden, der skal fratrækkes — supplerende kapital | Kapitalgrundlagselementer vedrørende andre ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerede kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0190/C0050 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndighed, der skal fratrækkes — resterende supplerende kapital | Kapitalgrundlagselementer vedrørende andre ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerede kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0200/C0010 | Minoritetsinteresser på koncernniveau — I alt | Minoritetsinteresser i alt i den koncern, som der indberettes oplysninger om. |
| R0200/C0020 | Minoritetsinteresser på koncernniveau — ubegrænset kernekapital | Minoritetsinteresser i den koncern, som der offentliggøres oplysninger om, og som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0200/C0030 | Minoritetsinteresser på koncernniveau — begrænsede kernekapitalelementer | Minoritetsinteresser i den koncern, som der offentliggøres oplysninger om, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0200/C0040 | Minoritetsinteresser på koncernniveau — supplerende kapital | Minoritetsinteresser i den koncern, som der indberettes oplysninger om, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0200/C0050 | Minoritetsinteresser på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Minoritetsinteresser i den koncern, som der indberettes oplysninger om, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0210/C0010 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Minoritetsinteresser i alt, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0210/C0020 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital ubegrænset | Minoritetsinteresser, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for ubegrænset kernekapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0210/C0030 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau — kernekapital begrænset | Minoritetsinteresser, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for begrænset kernekapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0210/C0040 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Minoritetsinteresser, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0210/C0050 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Minoritetsinteresser, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital og skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke bør medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II

| | | |
|-------------|---|--|
| R0220/C0010 | Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — I alt | <p>Kapitalgrundlagselementer i alt, jf. regnskabet, som ikke medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II.</p> <p>Disse kapitalgrundlagselementer er enten:</p> <ul style="list-style-type: none"> i) elementer, som er angivet i listen over kapitalgrundlagselementer, men som ikke opfylder kriterierne for klassificering eller overgangsbestemmelserne, eller ii) elementer, som skal fungere som kapitalgrundlag, som ikke er angivet i listen over kapitalgrundlagselementer og ikke er godkendt af tilsynsmyndigheden, og som ikke er balanceført som gæld. <p>Efterstillet gæld, som ikke tæller som basiskapitalgrundlag, skal ikke indberettes her, men på balancen (skema S.02.01) som efterstillet gæld, som ikke tæller som basiskapitalgrundlag.</p> |
|-------------|---|--|

Fradrag

| | | |
|-------------|---|---|
| R0230/C0010 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — i alt | <p>Fradrag vedrørende kapitalinteresser i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, herunder kapitalinteresser, der fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Disse kapitalinteresser fratrækkes basiskapitalgrundlaget og tilbageføres som kapitalgrundlag efter de relevante sektorbestemte regler i rækkerne fra R0410-R0440.</p> |
| R0230/C0020 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — kernekapital ubegrænset | <p>Fradrag vedrørende kapitalinteresser i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, herunder kapitalinteresser, der fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF (anføres særskilt i række R0240).</p> <p>Disse kapitalinteresser fratrækkes basiskapitalgrundlaget og tilbageføres som kapitalgrundlag efter de relevante sektorbestemte regler i rækkerne fra R0410-R0440 — kernekapital ubegrænset.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0230/C0030 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — kernekapital begrænset | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i kreditinstitutter, investeringselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, herunder kapitalinteresser, der fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. Disse kapitalinteresser fratrækkes basiskapitalgrundlaget og tilbageføres som kapitalgrundlag efter de relevante sektorbestemte regler i rækkerne fra R0410-R0440 — kernekapital begrænset. |
| R0230/C0040 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — supplerende kapital | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i kreditinstitutter, investeringselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, herunder kapitalinteresser, der fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. Disse kapitalinteresser fratrækkes basiskapitalgrundlaget og tilbageføres som kapitalgrundlag efter de relevante sektorbestemte regler i rækkerne fra R0410-R0440 — supplerende kapital. |
| R0230/C0050 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i andre finansielle selskaber, herunder ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — resterende supplerende kapital | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i kreditinstitutter, investeringselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, herunder kapitalinteresser, der fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. Disse kapitalinteresser fratrækkes basiskapitalgrundlaget og tilbageføres som kapitalgrundlag efter de relevante sektorbestemte regler i rækkerne fra R0410-R0440 — resterende supplerende kapital. |
| R0240/C0010 | Heraf fratrukket i henhold til artikel 228 i direktiv 2009/138/EF — I alt | Kapitalinteresser i alt fratrukket i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som en del af det beløb, der er indberettet i række R0230 — I alt. |
| R0240/C0020 | Heraf fratrukket i henhold til artikel 228 i direktiv 2009/138/EF — kernekapital ubegrænset | Kapitalinteresser fratrukket i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som en del af den værdi, der er indberettet i række R0230 — ubegrænset kernekapital. |
| R0240/C0030 | Heraf fratrukket i henhold til artikel 228 i direktiv 2009/138/EF — kernekapital begrænset | Kapitalinteresser fratrukket i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som en del af den værdi, der er indberettet i række R0230 — begrænset kernekapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0240/C0040 | Heraf fratrukket i henhold til artikel 228 i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Kapitalinteresser fratrukket i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF, som en del af den værdi, der er indberettet i række R0230 — supplerende kapital. |
| R0250/C0010 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229) — i alt | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, når de informationer, der er nødvendige til beregning af koncernsolvensen, mangler, jf. artikel 229 i direktiv 2009/138/EF. |
| R0250/C0020 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229) — kernekapital ubegrænset | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, når de nødvendige informationer, der er krævet til beregning af koncernsolvensen, mangler, jf. artikel 229 i direktiv 2009/138/EF — ubegrænset kernekapital. |
| R0250/C0030 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229) — kernekapital begrænset | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, når de nødvendige informationer, der er nødvendige til beregning af koncernsolvensen, mangler, jf. artikel 229 i direktiv 2009/138/EF — begrænset kernekapital. |
| R0250/C0040 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229) — supplerende kapital | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, når de informationer, der er nødvendige til beregning af koncernsolvensen, mangler, jf. artikel 229 i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital. |
| R0250/C0050 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser, hvor informationer mangler (artikel 229) — resterende supplerende kapital | Fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber, når de informationer, der er nødvendige til beregning af koncernsolvensen, mangler, jf. artikel 229 i direktiv 2009/138/EF — resterende supplerende kapital. |
| R0260/C0010 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — I alt | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder. |
| R0260/C0020 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — kernekapital ubegrænset | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — ubegrænset kernekapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0260/C0030 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — kernekapital begrænset | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — begrænset kernekapital. |
| R0260/C0040 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — supplerende kapital | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — supplerende kapital. |
| R0260/C0050 | Fradrag vedrørende kapitalinteresser efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — resterende supplerende kapital | Det samlede fradrag vedrørende kapitalinteresser i tilknyttede selskaber efter metoden med fradrag og aggregering, når der anvendes en kombination af metoder — resterende supplerende kapital. |
| R0270/C0010 | Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer, der skal fratrækkes — I alt | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer i alt, som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0270/C0020 | Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer, der skal fratrækkes — kernekapital ubegrænset | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer i ubegrænsede kernekapitalelementer, som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0270/C0030 | Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer, der skal fratrækkes — kernekapital begrænset | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer — begrænsede kernekapitalelementer, som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0270/C0040 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer i alt, der skal fratrækkes — supplerende kapital | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer — supplerende kapital, som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0270/C0050 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer i alt, der skal fratrækkes — resterende supplerende kapital | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlagselementer — resterende supplerende kapital, som skal fratrækkes i henhold til artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0280/C0010 | Samlede fradrag — I alt | Samlede fradrag, der ikke er medregnet i afstemningsreserven. |
| R0280/C0020 | Samlede fradrag — kernekapital ubegrænset | Fradrag i ubegrænsede kernekapitalelementer, der ikke er medregnet i afstemningsreserven. |
| R0280/C0030 | Samlede fradrag — kernekapital begrænset | Fradrag i begrænsede kernekapitalelementer, der ikke er medregnet i afstemningsreserven. |
| R0280/C0040 | Samlede fradrag — supplerende kapital | Fradrag i den supplerende kapital, der ikke er medregnet i afstemningsreserven. |
| R0280/C0050 | Samlede fradrag — resterende supplerende kapital | Fradrag i den resterende supplerende kapital, der ikke er medregnet i afstemningsreserven. |

Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag

| | | |
|-------------|--|---|
| R0290/C0010 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag | Basiskapitalgrundlagselementer i alt efter fradrag. |
| R0290/C0020 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — kernekapital ubegrænset | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0290/C0030 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — kernekapital begrænset | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0290/C0040 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — supplerende kapital | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0290/C0050 | Samlet basiskapitalgrundlag efter fradrag — resterende supplerende kapital | Basiskapitalgrundlagselementer efter fradrag, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

Supplerende kapitalgrundlag

| | | |
|-------------|---|---|
| R0300/C0010 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt — I alt | Udstedt, ikkeindkaldt og ikkeindbetalt stamaktiekapital i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0300/C0040 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt stamaktiekapital, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0310/C0010 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt — I alt | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt garantikapital og ikkeindkaldte og ikkeindbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0310/C0040 | Ikkeindbetalt og ikkeindkaldt garantikapital og ikkeindbetalte og ikkeindkaldte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldt og ikkeindbetalt garantikapital og ikkeindkaldte og ikkeindbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0320/C0010 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — I alt | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier i alt, som kan kræves indkaldt. |
| R0320/C0040 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — supplerende kapital | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0320/C0050 | Ikkeindbetalte og ikkeindkaldte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt — resterende supplerende kapital | Ikkeindkaldte og ikkeindbetalte præferenceaktier, som kan kræves indkaldt, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0330/C0010 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — I alt | Juridisk bindende forpligtelser i alt til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning. |
| R0330/C0040 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — supplerende kapital | Juridisk bindende forpligtelser til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0330/C0050 | En juridisk bindende forpligtelse til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning — resterende supplerende kapital | Juridisk bindende forpligtelser til at tegne og betale for efterstillet gæld efter anmodning, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0340/C0010 | Rembuser og garantier henhørende under artikel 96, nr. 2, i direktiv 2009/138/EF — I alt | Rembuser og garantier i alt, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0340/C0040 | Rembuser og garantier henhørende under artikel 96, nr. 2, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Rembuser og garantier, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF, og for hvilke det gælder, at de opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0350/C0010 | Rembuser og garantier ikke henhørende under artikel 96, nr. 2, i direktiv 2009/138/EF — I alt | Andre rembuser og garantier i alt, som opfylder kriterierne til supplerende kapital eller resterende supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0350/C0040 | Rembuser og garantier ikke henhørende under artikel 96, nr. 2, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Andre rembuser og garantier, som opfylder kriterierne til supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0350/C0050 | Rembuser og garantier ikke henhørende under artikel 96, nr. 2, i direktiv 2009/138/EF — resterende supplerende kapital | Andre rembuser og garantier, som opfylder kriterierne til resterende supplerende kapital, end dem, som forvaltes af et uafhængigt forvaltningsselskab til fordel for forsikringskreditorer, og som er udstedt og stillet af kreditinstitutter, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2006/48/EF. |
| R0360/C0010 | Indkaldelse af supplerende bidrag hos medlemmer henhørende under artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — I alt | Fremtidige fordringer i alt, som gensidige eller gensidiglignende redersammenslutninger med variable bidrag, der udelukkende forsikrer risici i klasse 6, 12 og 17 i bilag I, del A, kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder. |
| R0360/C0040 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag henhørende under artikel 96, nr. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende redersammenslutninger med variable bidrag, der udelukkende forsikrer risici i klasse 6, 12 og 17 i bilag I, del A, kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder. |
| R0370/C0010 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag ikke henhørende under artikel 96, nr. 3, første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — I alt | Fremtidige fordringer i alt, som disse gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, og som ikke falder ind under artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0370/C0040 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag, som ikke falder ind under artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — supplerende kapital | Andre fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, end dem, som er beskrevet i artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0370/C0050 | Indkaldelse hos medlemmer af supplerende bidrag, som ikke falder ind under artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF — resterende supplerende kapital | Andre fremtidige fordringer, som gensidige eller gensidiglignende sammenslutninger med variable bidrag kan gøre gældende over for deres medlemmer i form af indkaldelse af supplerende bidrag inden for de følgende 12 måneder, end dem, som er beskrevet i artikel 96, nr. 3), første afsnit, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0380/C0010 | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag, der skal fratrækkes på koncernniveau — I alt | Supplerende kapitalgrundlag i alt, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0380/C0040 | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag, der skal fratrækkes på koncernniveau — supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlag, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0380/C0050 | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag, der skal fratrækkes på koncernniveau — resterende supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlag, som anses for ikke at stå til rådighed, jf. artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF, og som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0390/C0010 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — I alt | Andre former for supplerende kapitalgrundlag i alt. |
| R0390/C0040 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital | Andre former for supplerende kapitalgrundlag, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0390/C0050 | Andre former for supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital | Andre former for supplerende kapitalgrundlag, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0400/C0010 | Samlet supplerende kapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlagselementer i alt. |
| R0400/C0040 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0400/C0050 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital | Supplerende kapitalgrundlagselementer, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| | Kapitalgrundlag i andre finansielle sektorer | |
| | Følgende poster er også relevante ved anvendelse af metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder. | |
| R0410/C0010 | Kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber — I alt | Kapitalgrundlag i alt i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner. Medtagelsen af andre finansielle sektorer følger artikel 329 i delegeret forordning (EU) 2015/35, hvis den ikke fratrækkes i henhold til artikel 228, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0410/C0020 | Kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber — kernekapital ubegrænset | Kapitalgrundlag i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — kernekapital ubegrænset. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0410/C0030 | Kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber — kernekapital begrænset | Kapitalgrundlag i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — kernekapital begrænset. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0410/C0040 | Kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber — supplerende kapital | Kapitalgrundlag i kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — supplerende kapital. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0420/C0010 | Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser — I alt | Kapitalgrundlag i alt i arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner. Disse poster bør også fratrækkes eventuelt ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0420/C0020 | Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser — kernekapital ubegrænset | Kapitalgrundlag i arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — ubegrænsede kernekapitalelementer. Disse poster bør også fratrækkes eventuelt ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler. |
| R0420/C0030 | Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser — kernekapital begrænset | Kapitalgrundlag i arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — begrænsede kernekapitalelementer. Disse poster bør også fratrækkes eventuelt ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler. |
| R0420/C0040 | Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser — supplerende kapital | Kapitalgrundlag i arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — supplerende kapital. Disse poster bør også fratrækkes eventuelt ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler. |
| R0420/C0050 | Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser — resterende supplerende kapital | Kapitalgrundlag i arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — resterende supplerende kapital. Disse poster bør også fratrækkes eventuelt ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler. |
| R0430/C0010 | Ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — I alt | Kapitalgrundlag i alt i ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0430/C0020 | Ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — kernekapital ubegrænset | Kapitalgrundlag i ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — kernekapital ubegrænset. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0430/C0030 | Ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — kernekapital begrænset | Kapitalgrundlag i ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — kernekapital begrænset. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |
| R0430/C0040 | Ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter — supplerende kapital | Kapitalgrundlag i ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, allerede fratrukket eventuelle relevante koncerninterne transaktioner — supplerende kapital. Disse poster bør også fratrækkes ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i henhold til de relevante sektorbestemte regler og fratrækkes kapitalgrundlag i henhold til artikel 228, afsnit 2, i direktiv 2009/138/EF. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| R0440/C0010 | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — I alt | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer. Værdien af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer fratrækkes i R0230, og kapitalgrundlaget i henhold til den sektorbestemte regel for sådanne selskabers kapitalgrundlag indberettes i R0440. |
| R0440/C0020 | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — kernekapital ubegrænset | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — kernekapital ubegrænset. Værdien af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer fratrækkes i R0230, og kapitalgrundlaget i henhold til den sektorbestemte regel for sådanne selskabers kapitalgrundlag indberettes i R0440. |
| R0440/C0030 | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — kernekapital begrænset | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — kernekapital begrænset. Værdien af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer fratrækkes i R0230, og kapitalgrundlaget i henhold til den sektorbestemte regel for sådanne selskabers kapitalgrundlag indberettes i R0440. |
| R0440/C0040 | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — supplerende kapital | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — supplerende kapital. Værdien af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer fratrækkes i R0230, og kapitalgrundlaget i henhold til den sektorbestemte regel for sådanne selskabers kapitalgrundlag indberettes i R0440. |
| R0440/C0050 | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — resterende supplerende kapital | Kapitalgrundlag i alt i andre finansielle sektorer — resterende supplerende kapital. Værdien af kapitalinteresser i andre finansielle sektorer fratrækkes i R0230, og kapitalgrundlaget i henhold til den sektorbestemte regel for sådanne selskabers kapitalgrundlag indberettes i R0440. |
| <i>Kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering anvendes, alene eller i kombination med metode 1</i> | | |
| R0450/C0010 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes — I alt | Samlet anerkendt kapitalgrundlag i de tilknyttede selskaber, som skal tillægges med henblik på beregningen af det aggregerede kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes, efter fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau. |
| R0450/C0020 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i de tilknyttede selskaber, som skal tillægges med henblik på beregningen af det aggregerede kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes, klassificeret som ubegrænset kernekapital, efter fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0450/C0030 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes — kernekapital begrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i de tilknyttede selskaber, som skal tillægges med henblik på beregningen af det aggregerede kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes, klassificeret som begrænset kernekapital, efter fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau. |
| R0450/C0040 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i de tilknyttede selskaber, som skal tillægges med henblik på beregningen af det aggregerede kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes, klassificeret som supplerende kapital, efter fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau. |
| R0450/C0050 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder anvendes — resterende supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i de tilknyttede selskaber, som skal tillægges med henblik på beregningen af det aggregerede kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering eller en kombination af metoder anvendes, klassificeret som resterende supplerende kapital, efter fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau. |
| R0460/C0010 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder eksklusive koncerninterne transaktioner anvendes — I alt | Anerkendt kapitalgrundlag i alt efter eliminering af koncerninterne transaktioner med henblik på beregning af det aggregerede anerkendte kapitalgrundlag på koncernniveau. Det her indberettede kapitalgrundlag skal være eksklusive ikke til rådighed stående kapitalgrundlag og eksklusive koncerninterne transaktioner. |
| R0460/C0020 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder eksklusive koncerninterne transaktioner anvendes — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag efter eliminering af koncerninterne transaktioner med henblik på beregning af det aggregerede anerkendte kapitalgrundlag på koncernniveau, klassificeret som ubegrænsede kernekapitalelementer. Det her indberettede kapitalgrundlag skal være eksklusive ikke til rådighed stående kapitalgrundlag og eksklusive koncerninterne transaktioner. |
| R0460/C0030 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder eksklusive koncerninterne transaktioner anvendes — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag efter eliminering af koncerninterne transaktioner med henblik på beregning af det aggregerede anerkendte kapitalgrundlag på koncernniveau, klassificeret som begrænsede kernekapitalelementer. Det her indberettede kapitalgrundlag skal være eksklusive ikke til rådighed stående kapitalgrundlag og eksklusive koncerninterne transaktioner. |
| R0460/C0040 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder eksklusive koncerninterne transaktioner anvendes — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag efter eliminering af koncerninterne transaktioner med henblik på beregning af det aggregerede anerkendte kapitalgrundlag på koncernniveau, klassificeret som supplerende kapital. Det her indberettede kapitalgrundlag skal være eksklusive ikke til rådighed stående kapitalgrundlag og eksklusive koncerninterne transaktioner. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0460/C0050 | Aggregeret kapitalgrundlag, når metoden med fradrag og aggregering og en kombination af metoder eksklusive koncerninterne transaktioner anvendes — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag efter eliminering af koncerninterne transaktioner med henblik på beregning af det aggregerede anerkendte kapitalgrundlag på koncernniveau, klassificeret som resterende supplerende kapital. Det her indberettede kapitalgrundlag skal være eksklusive ikke til rådighed stående kapitalgrundlag og eksklusive koncerninterne transaktioner. |
| R0520/C0010 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — I alt | Selskabets samlede kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag plus supplerende kapitalgrundlag, som står til rådighed til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. |
| R0520/C0020 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — kernekapital ubegrænset | Selskabets kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0520/C0030 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — kernekapital begrænset | Selskabets kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0520/C0040 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — supplerende kapital | Selskabets kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag plus supplerende kapitalgrundlag, som står til rådighed til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0520/C0050 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — resterende supplerende kapital | Selskabets kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag plus supplerende kapitalgrundlag, som står til rådighed til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som resterende supplerende kapital. |
| R0560/C0010 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — I alt | Koncernens samlede kapitalgrundlag, som er anerkendt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering i henhold til de fastsatte grænser. Med hensyn til om disse kapitalgrundlagselementer kan anerkendes, indregnes kapitalkravene fra andre finansielle sektorer ikke systematisk i de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (artikel 336, litra c), i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| R0560/C0020 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — kernekapital ubegrænset | Koncernens kapitalgrundlag, som er anerkendt i henhold til de fastsatte grænser til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0560/C0030 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — kernekapital begrænset | Kapitalgrundlag, som er anerkendt i henhold til de fastsatte grænser til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0560/C0040 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — supplerende kapital | Kapitalgrundlag, som er anerkendt i henhold til de fastsatte grænser til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0560/C0050 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — resterende supplerende kapital | Kapitalgrundlag, som er anerkendt i henhold til de fastsatte grænser til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0530/C0010 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — I alt | Koncernens samlede kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav, eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. |
| R0530/C0020 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav — kernekapital ubegrænset | Koncernens kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav, men eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0530/C0030 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav — kernekapital begrænset | Koncernens kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav, men eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0530/C0040 | Samlet til rådighed stående kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — supplerende kapital | Koncernens kapitalgrundlag, omfattende basiskapitalgrundlag efter fradrag, som står til rådighed til opfyldelse af koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav, men eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapitalelementer. |
| R0570/C0010 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — I alt | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusiv kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) |
| R0570/C0020 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag på koncernniveau, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau, men eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0570/C0030 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — kernekapital begrænset | Anerkendt kapitalgrundlag på koncernniveau, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0570/C0040 | Samlet anerkendt kapitalgrundlag til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag på koncernniveau, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau, men eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapital. |
| R0800/C0010 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — I alt | Anerkendt kapitalgrundlag i alt, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men eksklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering — I alt. |
| R0800/C0020 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i alt, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men eksklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0800/C0030 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital begrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i alt, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men eksklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0800/C0040 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i alt, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men eksklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0800/C0050 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af de konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, eksklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — resterende supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i alt, som står til rådighed til opfyldelse af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men eksklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som resterende supplerende kapital. |
| R0810/C0010 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — I alt | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — I alt |
| R0810/C0020 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men inklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0810/C0030 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital begrænset | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men inklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0810/C0040 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men inklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0810/C0050 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, inklusive kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — resterende supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, men inklusive kapitalgrundlaget fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, som opfylder kriterierne for at indgå som resterende supplerende kapital. |
| R0660/C0010 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (eksklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — I alt | Samlet anerkendt kapitalgrundlag, inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav. |
| R0660/C0020 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital ubegrænset | Anerkendt kapitalgrundlag, inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav, som opfylder kriterierne for at indgå som ubegrænsede kernekapitalelementer. |
| R0660/C0030 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — kernekapital begrænset | Anerkendt kapitalgrundlag, inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav, som opfylder kriterierne for at indgå som begrænsede kernekapitalelementer. |
| R0660/C0040 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — supplerende kapital | Anerkendt kapitalgrundlag, inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav, som opfylder kriterierne for at indgå som supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0660/C0050 | Anerkendt kapitalgrundlag i alt til opfyldelse af det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau (inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering) — resterende supplerende kapital | Anerkendt til rådighed stående kapitalgrundlag, inklusive kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer og fra selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav, som opfylder kriterierne for at indgå som resterende supplerende kapital. |
| R0820/C0010 | Den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, — I alt | Den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusiv kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering Solvenskapitalkravet baseret på artikel 336, litra a), b), d) og e) i delegeret forordning (EU) 2015/35, herunder ethvert kapitaltillæg. Ved kvartalsvis indberetning er dette det seneste beløb for solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at solvenskapitalkravet er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), herunder et kapitaltillæg. |
| R0610/C0010 | Konsolideret minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau | Konsolideret minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau beregnet for de konsoliderede data (metode 1), jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF. |
| R0860/C0010 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer | Det samlede kapitalkrav for tilknyttede selskaber, der hører til andre finansielle sektorer, som beregnet i overensstemmelse med de sektorbestemte regler. |
| R0590/C0010 | Det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, eksklusiv solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau beregnet for de konsoliderede data i henhold til metode 1, jf. artikel 336, litra a), b), c), d) og e), i delegeret forordning (EU) 2015/35. Inklusive ethvert kapitaltillæg. Hvis det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau (R0610/C0010) er højere end summen af R0820/C0010 og R0860/C0010, indberettes dette minimum (R0610/C0010) Ved kvartalsvis indberetning er dette det seneste beløb for solvenskapitalkrav, som skal beregnes og indberettes, enten beløbet for året eller et senere, i tilfælde af at solvenskapitalkravet er genberegnet (f.eks. i forbindelse med ændringer i risikoprofilen), herunder et kapitaltillæg. |
| R0670/C0010 | Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering. | De samlede solvenskapitalkrav for tilknyttede selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. Denne celle omfatter summen af den proportionale andel af solvenskapitalkravet for selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. Den er kun relevant i tilfælde af metoden med aggregering og fradrag og en kombination af metoder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0830/C0010 | Solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer, inklusive solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | Solvenskapitalkravet på koncernniveau er summen af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau beregnet i henhold til artikel 336, stk. a), b), d) og e), i delegeret forordning (EU) 2015/35 og ethvert kapitaltillæg (R0820/C0010) og solvenskapitalkrav for enheder, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering (R0670/C0010). Hvis det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau (R0610/C0010) er højere end indberettet under R0820/C0100, så er koncernens solvenskapitalkrav summen af R0610/C0010 og R0670/C0010. Koncernens solvenskapitalkrav skal ikke indeholde kapitalkrav fra andre finansielle sektorer (artikel 336, litra c), i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| R0680/C0010 | Det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau, inklusive kapitalgrundlaget fra andre finansielle sektorer og solvenskapitalkravet for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | De samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau er summen af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (R0590/C0010) og solvenskapitalkravet for selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering (R0670/C0010). |
| R0630/C0010 | Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0560) og den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau (R0820), heri er andre finansielle sektorer og selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering, ikke medregnet | Solvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau divideret med den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau, eksklusive kapitalgrundlaget og kapitalkrav for andre finansielle sektorer og kapitalgrundlaget og solvenskapitalkrav for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. |
| R0650/C0010 | Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0570) og det konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav på koncernniveau (R0610). | Minimumssolvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav divideret med koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav (eksklusive andre finansielle sektorer og de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering). |
| R0840/C0010 | Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0800) og koncernens konsoliderede solvenskapitalkrav (R0590), inklusive andre finansielle sektorer, men eksklusive selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | Solvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af koncernens konsoliderede solvenskapitalkrav divideret med koncernens konsoliderede solvenskapitalkrav (inklusive kapitalkrav og kapitalgrundlag fra andre finansielle sektorer, men eksklusive solvenskapitalkrav og kapitalgrundlag fra de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering). |
| R0850/C0010 | Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0810) og koncernens solvenskapitalkrav (R0830), eksklusive andre finansielle sektorer, men inklusive selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | Solvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af den konsoliderede del af solvenskapitalkravet på koncernniveau divideret med koncernens konsoliderede solvenskapitalkrav, eksklusive kapitalgrundlaget og kapitalkrav fra andre finansielle sektorer, men inklusive kapitalgrundlaget og solvenskapitalkrav for de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0690/C0010 | Forholdet mellem det anerkendte kapitalgrundlag (R0660) i alt og koncernens samlede solvenskapitalkrav (R0680), inklusive andre finansielle sektorer og selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering | Solvensprocenten beregnet som det samlede anerkendte kapitalgrundlag til opfyldelse af koncernens samlede solvenskapitalkrav divideret med koncernens samlede solvenskapitalkrav (inklusive andre finansielle sektorer og de selskaber, der er omfattet af metoden med fradrag og aggregering). |

Afstemmingsreserve

| | | |
|-------------|---|--|
| R0700/C0060 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Overskydende aktiver i forhold til passiver som indberettet i Solvens II-balancen. |
| R0710/C0060 | Egne aktier (som besiddes direkte og indirekte) | Egne aktier, som besiddes af det deltagende forsikrings- eller genforsikrings-selskab, forsikringsholdings-selskabet eller det blandede finansielle holdings-selskab og de tilknyttede selskaber, både direkte og indirekte. |
| R0720/C0060 | Påregnelige udbytter, udlodninger og gebyrer | Udbytter, udlodninger og gebyrer, som kan påregnes af koncernen. |
| R0730/C0060 | Andre basiskapitalgrundlagselementer | Basiskapitalgrundlagselementerne omfattet af artikel 69, litra a), nr. i)-v), artikel 72, litra a), og artikel 76, litra a), samt de basiskapitalgrundlagselementer, som tilsynsmyndigheden har godkendt i henhold til artikel 79 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0740/C0060 | Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Den samlede justering af afstemningsreserven som følge af forekomsten af begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med ring-fenced fonde og matchningsporteføljer på koncernniveau. |
| R0750/C0060 | Andet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag | Andet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag som f.eks. i tilknyttede selskaber i henhold til artikel 335, stk. 1, litra d) og f), i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0760/C0060 | Afstemmingsreserve — I alt | Afstemmingsreserven for koncernen. |
| R0770/C0060 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — livsforsikring | Afstemmingsreserven indeholder et beløb for overskydende aktiver i forhold til passiver, som svarer til den forventede fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. I denne celle anføres dette beløb for så vidt angår koncernens livsforsikringsvirksomhed. |
| R0780/C0060 | Forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier — skadesforsikring | Afstemmingsreserven indeholder et beløb for overskydende aktiver i forhold til passiver, som svarer til den forventede fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. I denne celle anføres dette beløb for så vidt angår koncernens livsforsikringsvirksomhed. |
| R0790/C0060 | Samlet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier | Det samlede beløb for beregnet forventet fortjeneste indeholdt i fremtidige præmier. |

S.23.02 — Detaljerede oplysninger om kapitalgrundlag opdelt efter kernekapital, supplerende kapital eller resterende supplerende kapital (tidligere benævnt tier 1, tier 2, og tier 3)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for koncerner, når metode 1 anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital — Indbetalt — I alt | Den samlede indbetalte stamaktiekapital inklusive egne aktier. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital — indbetalt — kernekapital | Den samlede indbetalte stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, inklusive egne aktier. |
| R0020/C0010 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — I alt | Den samlede indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital inklusive egne aktier. |
| R0020/C0040 | Stamaktiekapital — indkaldt, men endnu ikke indbetalt — supplerende kapital | Den samlede indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, inklusive egne aktier. |
| R0030/C0010 | Beholdning af egne aktier — I alt | Det samlede beløb for egne aktier, som besiddes af selskabet. |
| R0030/C0020 | Beholdning af egne aktier — kernekapital | Det samlede beløb for egne aktier, som besiddes af selskabet, og som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0100/C0010 | Samlet stamaktiekapital | Den samlede stamaktiekapital. Bemærk, at beholdning af egne aktier medregnes under enten indbetalt eller indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital. |
| R0100/C0020 | Samlet stamaktiekapital — kernekapital | Den samlede stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. Bemærk, at beholdning af egne aktier medregnes under enten indbetalt eller indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0100/C0040 | Samlet stamaktiekapital — supplerende kapital | Den samlede stamaktiekapital, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0110/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — I alt | Den samlede indbetalte garantikapital og de samlede indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber. |
| R0110/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — kernekapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for kernekapital |
| R0120/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — I alt | Den samlede garantikapital og de samlede medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som er indkaldt, men endnu ikke indbetalt. |
| R0120/C0040 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — indkaldt, men endnu ikke indbetalt — supplerende kapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital |
| R0200/C0010 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber |
| R0200/C0020 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — kernekapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for kernekapital |
| R0200/C0040 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — supplerende kapital | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, som opfylder kriterierne for supplerende kapital |
| R0210/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — I alt | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti. |
| R0210/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0210/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0210/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0210/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0210/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — daterede efterstillede — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende daterede efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0220/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — I alt | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option. |
| R0220/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0220/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0220/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0220/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0220/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede med en call-option — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti med en call-option, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0230/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0230/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0230/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0230/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0230/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0230/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — udaterede efterstillede uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende udaterede efterstillede gensidige medlemskonti uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0300/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti. |
| R0300/C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt— kernekapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0300/C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0300/C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0300/C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Det samlede beløb vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0300/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — resterende supplerende kapital | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0310/C0010 | Daterede præferenceaktier — I alt | Daterede præferenceaktier i alt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0310/C0020 | Daterede præferenceaktier — kernekapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0310/C0030 | Daterede præferenceaktier — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Daterede præferenceaktier, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0310/C0040 | Daterede præferenceaktier — supplerende kapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0310/C0050 | Daterede præferenceaktier — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Daterede præferenceaktier, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0310/C0060 | Daterede præferenceaktier — resterende supplerende kapital | Daterede præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0320/C0010 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — I alt | Det samlede beløb for udaterede præferenceaktier med en call-option. |
| R0320/C0020 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — kernekapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0320/C0030 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0320/C0040 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0320/C0050 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0320/C0060 | Udaterede præferenceaktier med en call-option — resterende supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier med en call-option, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0330/C0010 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Det samlede beløb for udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0330/C0020 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0330/C0030 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0330/C0040 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0330/C0050 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0330/C0060 | Udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | De udaterede præferenceaktier uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0400/C0010 | Præferenceaktier i alt | Præferenceaktier i alt. |
| R0400/C0020 | Præferenceaktier i alt — kernekapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer, i alt. |
| R0400/C0030 | Præferenceaktier i alt — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Præferenceaktier, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0400/C0040 | Præferenceaktier i alt — supplerende kapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer, i alt. |
| R0400/C0050 | Præferenceaktier i alt — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Præferenceaktier, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne, i alt. |
| R0400/C0060 | Præferenceaktier i alt — resterende supplerende kapital | Præferenceaktier, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital, i alt. |
| R0410/C0010 | Dateret efterstillet gæld — I alt | Den samlede daterede efterstillede gæld. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0410/C0020 | Dateret efterstillet gæld — kernekapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for kernekapital. |
| R0410/C0030 | Dateret efterstillet gæld — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den daterede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0410/C0040 | Dateret efterstillet gæld — supplerende kapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0410/C0050 | Dateret efterstillet gæld — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den daterede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0410/C0060 | Dateret efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Dateret efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0420/C0010 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Den samlede udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0420/C0020 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0420/C0030 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0420/C0040 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0420/C0050 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0420/C0060 | Udateret efterstillet gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld med indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0430/C0010 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — I alt | Den samlede udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten. |
| R0430/C0020 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0430/C0030 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0430/C0040 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| R0430/C0050 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0430/C0060 | Udateret efterstillet gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten — resterende supplerende kapital | Den udaterede efterstillede gæld uden indløsningsmulighed i henhold til kontrakten, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0500/C0010 | Samlet efterstillet gæld — I alt | Den samlede efterstillede gæld. |
| R0500/C0020 | Samlet efterstillet gæld — kernekapital | Den samlede efterstillede gæld, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |
| R0500/C0030 | Samlet efterstillet gæld — kernekapital, jf. overgangsbestemmelser | Den samlede efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for kernekapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0500/C0040 | Samlet efterstillet gæld — supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for supplerende kapital. |
| R0500/C0050 | Samlet efterstillet gæld — supplerende kapital, jf. overgangsbestemmelser | Den efterstillede gæld, som opfylder de kriterier for supplerende kapitalelementer, der er anført under overgangsbestemmelserne. |
| R0500/C0060 | Samlet efterstillet gæld — resterende supplerende kapital | Efterstillet gæld, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| R0510/C0070 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — godkendte oprindelige supplerende kapitalbeløb | Det godkendte oprindelige beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under supplerende kapital. |
| R0510/C0080 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — aktuelle supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under supplerende kapital. |
| R0510/C0090 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — godkendte oprindelige resterende supplerende kapitalbeløb | Det godkendte oprindelige beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under resterende supplerende kapital. |
| R0510/C0100 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke et beløb er godkendt — aktuelle resterende supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket et beløb er godkendt under resterende supplerende kapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0520/C0080 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke en metode er godkendt — aktuelle supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket en metode er godkendt under supplerende kapital. |
| R0520/C0100 | Supplerende kapitalgrundlagselementer, for hvilke en metode er godkendt — aktuelle resterende supplerende kapitalbeløb | Det aktuelle beløb vedrørende supplerende kapitalgrundlag, for hvilket en metode er godkendt under resterende supplerende kapital. |
| R0600/C0110 | Overskydende aktiver i forhold til passiver — Fordeling af forskelle i værdiansættelse — Forskelle i værdiansættelse af aktiver | Forskelle i værdiansættelsen af aktiver. |
| R0610/C0110 | Overskydende aktiver i forhold til passiver — Fordeling af forskelle i værdiansættelse — Forskelle i værdiansættelse af forsikringsmæssige hensættelser | Forskelle i værdiansættelsen af forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0620/C0110 | Overskydende aktiver i forhold til passiver — Fordeling af forskelle i værdiansættelse — Forskelle i værdiansættelse af øvrige forpligtelser | Forskelle i værdiansættelsen af øvrige forpligtelser. |
| R0630/C0110 | Reserver og overført resultat i alt, jf. regnskab | Summen af reserver og overført resultat, jf. regnskabet. |
| R0640/C0110 | Andet; begrund, hvorfor denne række anvendes | Beløb for andre, ikke allerede angivne elementer. Ved indberetning i R0640/C0110, skal der i R0640/C0120 angives nærmere oplysninger om sådanne elementer. |
| R0640/C0120 | Andet; begrund, hvorfor denne række anvendes | Nærmere oplysninger om andre elementer indberettet i R0640/C0110. |
| R0650/C0110 | Reserver jf. regnskab reguleret for Solvens II-værdiansættelsesforskelle | Summen af reserver fra årsregnskabet efter justering for værdiansættelsesforskelle. I denne post medregnes regnskabsposter såsom overført resultat, reservekapital, nettooverskud, overskud fra foregående år, opskrivningshenlæggelser og anden reservekapital. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0660/C0110 | Overskydende aktiver i forhold til passiver, som kan tilskrives basiskapitalgrundlagselementer (eksklusive afstemningsreserven) | Overskydende aktiver i forhold til passiver, som kan tilskrives basiskapitalgrundlagselementer eksklusive afstemningsreserven |
| R0700/C0110 | Overskydende aktiver i forhold til passiver | Overskydende aktiver i forhold til passiver. |

S.23.03 — Årlige bevægelser i kapitalgrundlaget

Generelle bemærkninger:

Dette skema skal indberettes, hvis beløbet for kapitalgrundlaget for kernekapital (tier 1), supplerende kapital (tier 2) og resterende supplerende kapital (tier 3) ændres med mere end 5 % i forhold til det foregående år beregnet som nedenfor.

$$\% \text{ - ændring } (T; T - 1) := \frac{\text{Available Own funds in tier } i \text{ to cover SCR in } T}{\text{Available Own funds in tier } i \text{ to cover SCR in } T - 1}$$

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for koncerner, når metode 1 anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| | <i>Stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | |
| R0010/C0010 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indbetalt stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0010/C0020 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Stigning | Stigning i den indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0010/C0030 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Fald | Fald i den indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0010/C0060 | Stamaktiekapital — Indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indbetalt stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0020/C0010 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0020/C0020 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Stigning | Stigning i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| R0020/C0030 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Fald | Fald i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0020/C0060 | Stamaktiekapital — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0030/C0010 | Beholdning af egne aktier — Overført fra foregående periode | Beholdning af egne aktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0030/C0020 | Beholdning af egne aktier — Stigning | Stigning i beholdningen af egne aktier i indberetningsperioden. |
| R0030/C0030 | Beholdning af egne aktier — Fald | Fald i beholdningen af egne aktier i indberetningsperioden. |
| R0030/C0060 | Beholdning af egne aktier — Overført til efterfølgende periode | Beholdning af egne aktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0100/C0010 | Samlet stamaktiekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for den samlede stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. R0100/C0010 omfatter beholdning af egne aktier. |
| R0100/C0020 | Samlet stamaktiekapital — Stigning | Stigning i den samlede stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0100/C0030 | Samlet stamaktiekapital — Fald | Fald i den samlede stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0100/C0060 | Samlet stamaktiekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for den samlede stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0110/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0110/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0110/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0110/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0120/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0120/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0120/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0120/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0200/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Overført fra foregående periode | Samlet saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0200/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0200/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital i indberetningsperioden. |
| R0200/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital — I alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende stamaktiekapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Bevægelser i indberetningsperioden | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0210/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Overført fra foregående periode | Beløbet for indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført fra foregående indberetningsperiode |
| R0210/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Stigning | Stigningen i indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0210/C0030 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Fald | Reduktionen i indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0210/C0060 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Beløbet for indbetalt garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført til efterfølgende indberetningsperiode |
| R0220/C0010 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført fra foregående periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt garantikapital og indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0220/C0020 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Stigning | Stigning i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte garantikapital og de indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden. |
| R0220/C0030 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Fald | Fald i den indkaldte, men endnu ikke indbetalte garantikapital og de indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0220/C0060 | Garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — Indkaldt, men endnu ikke indbetalt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for indkaldt, men endnu ikke indbetalt garantikapital og indkaldte, men endnu ikke indbetalte medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0300/C0010 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — overført fra foregående periode | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført fra foregående indberetningsperiode |
| R0300/C0020 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — stigning | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0300/C0030 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — reduktion | Faldet i det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber i indberetningsperioden |
| R0300/C0060 | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber — overført til følgende periode | Det samlede beløb for garantikapital og medlemsbidrag eller tilsvarende basiskapitalgrundlagselementer for gensidige og gensidiglignende selskaber, overført til efterfølgende indberetningsperiode |
| <i>Efterstillede gensidige medlemskonti — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R0310/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0310/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0310/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0310/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0310/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0310/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0320/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0320/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0320/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0320/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0320/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0320/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0330/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|--|--|
| R0330/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — udstedt | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0330/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — indløst | Det beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0330/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0330/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler stigninger/fald i efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0330/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillede gensidige medlemskonti, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0400/C0010 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Overført fra foregående periode | Samlet saldo for efterstillede gensidige medlemskonti overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0400/C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Udstedt | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som er udstedt i indberetningsperioden. |
| R0400/C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Indløst | Det samlede beløb vedrørende efterstillede gensidige medlemskonti, som er indløst i indberetningsperioden. |
| R0400/C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler det samlede udsving i værdiansættelsen af efterstillede gensidige medlemskonti i indberetningsperioden. |
| R0400/C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler den samlede stigning/det samlede fald i efterstillede gensidige medlemskonti i indberetningsperioden som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0400/C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti i alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo i alt for efterstillede gensidige medlemskonti overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Overskudskapital</i> | | |
| R0500/C0010 | Overskudskapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overskudskapital overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0500/C0060 | Overskudskapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overskudskapital overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| | <i>Præferenceaktier — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | |
| R0510/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0510/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0510/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0510/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0520/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0520/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0520/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0520/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0530/C0010 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Beholdning af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0530/C0020 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — stigning | Stigning i beholdningen af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0530/C0030 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — fald | Fald i beholdningen af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0530/C0060 | Beholdning af præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Beholdning af præferenceaktier, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0600/C0010 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Overført fra foregående periode | Samlet beholdning af præferenceaktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0600/C0020 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Stigning | Stigning i den samlede beholdning af præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0600/C0030 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Fald | Fald i den samlede beholdning af præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0600/C0060 | Samlet beholdning af præferenceaktier — Overført til efterfølgende periode | Samlet beholdning af præferenceaktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier</i> | | |
| R0610/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0610/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0610/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0610/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0620/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0620/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0620/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0620/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0630/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0630/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — stigning | Stigning i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0630/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — fald | Fald i saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0630/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier, som er resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0700/C0010 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0700/C0020 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Stigning | Stigning i saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0700/C0030 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Fald | Fald i saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier i indberetningsperioden. |
| R0700/C0060 | Overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier — I alt — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| | <i>Efterstillet gæld — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | |
| R0710/C0010 | Efterstillet gæld — kernekapital — Overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, kernekapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0710/C0070 | Efterstillet gæld — kernekapital — Udstedt | Efterstillet gæld, kernekapital, udstedt i indberetningsperioden. |
| R0710/C0080 | Efterstillet gæld — kernekapital — Indløst | Efterstillet gæld, kernekapital, indløst i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0710/C0090 | Efterstillet gæld — kernekapital — Udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, kernekapital, i indberetningsperioden. |
| R0710/C0100 | Efterstillet gæld — kernekapital — Lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, kernekapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0710/C0060 | Efterstillet gæld — kernekapital — Overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, kernekapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0720/C0010 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0720/C0070 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — udstedt | Efterstillet gæld, supplerende kapital, udstedt i indberetningsperioden. |
| R0720/C0080 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — indløst | Efterstillet gæld, supplerende kapital, indløst i indberetningsperioden. |
| R0720/C0090 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, supplerende kapital, i indberetningsperioden. |
| R0720/C0100 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, supplerende kapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0720/C0060 | Efterstillet gæld — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0730/C0010 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0730/C0070 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — udstedt | Efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, udstedt i indberetningsperioden. |
| R0730/C0080 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — indløst | Efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, indløst i indberetningsperioden. |
| R0730/C0090 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, i indberetningsperioden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0730/C0100 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — lovgivningsmæssige tiltag | Beløb, som afspejler ændringer i efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0730/C0060 | Efterstillet gæld — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for efterstillet gæld, resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R0800/C0010 | Samlet efterstillet gæld — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet efterstillet gæld overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0800/C0070 | Samlet efterstillet gæld — udstedt | Samlet efterstillet gæld udstedt i indberetningsperioden. |
| R0800/C0080 | Samlet efterstillet gæld — Indløst | Samlet efterstillet gæld indløst i indberetningsperioden. |
| R0800/C0090 | Samlet efterstillet gæld — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af samlet efterstillet gæld i indberetningsperioden. |
| R0800/C0100 | Samlet efterstillet gæld — lovgivningsmæssige tiltag | Det beløb, som afspejler ændringer i samlet efterstillet gæld som følge af lovgivningsmæssige tiltag. |
| R0800/C0060 | Samlet efterstillet gæld — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet efterstillet gæld overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| | <i>Et beløb svarende til værdien af udskudte skatteaktiver</i> | |
| R0900/C0010 | Beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver netto — Overført fra foregående periode | Saldo for det beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R0900/C0060 | Beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver netto — Overført til efterfølgende periode | Saldo for det beløb, som svarer til værdien af udskudte skatteaktiver overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| | <i>Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basis-kapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R1000/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Ubegrænsede kernekapitalelementer — Overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1000/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer ubegrænset — Udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer. |
| R1000/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer. |
| R1000/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som kernekapitalelementer ubegrænset. |
| R1000/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1010/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som ubegrænsede elementer, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1010/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer. |
| R1010/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R1010/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som begrænsede elementer — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som kernekapitalelementer begrænset. |
| R1010/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital, som skal behandles som ubegrænsede elementer — Overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er kernekapital og skal behandles som begrænsede elementer, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1020/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1020/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital. |
| R1020/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1030/C0010 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R1030/C0070 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0080 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — indløst | Det i indberetningsperioden indløste beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0090 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — udsving i værdiansættelse | Beløb, som afspejler udsvinget i værdiansættelsen af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital. |
| R1030/C0060 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden, som er resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1100/C0010 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1100/C0070 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Udstedt | Det i indberetningsperioden udstedte samlede beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |
| R1100/C0080 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — indløst | Det i indberetningsperioden indløste samlede beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |
| R1100/C0090 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Udsving i værdiansættelse | Det beløb, som afspejler udsvinget i ansættelsen af den samlede værdi af andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| R1100/C0060 | Samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet beløb vedrørende andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| <i>Supplerende kapitalgrundlag — Bevægelser i indberetningsperioden</i> | | |
| R1110/C0010 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for det supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1110/C0110 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — nyt beløb gjort tilgængeligt | Nyt supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1110/C0120 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital i indberetningsperioden. |
| R1110/C0130 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — indkaldt som basiskapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1110/C0060 | Supplerende kapitalgrundlag — supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1120/C0010 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — overført fra foregående periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, overført fra den foregående indberetningsperiode. |
| R1120/C0110 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — nyt beløb gjort tilgængeligt | Nyt supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1120/C0120 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital i indberetningsperioden. |
| R1120/C0130 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — indkaldt som basiskapitalgrundlag | Supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1120/C0060 | Supplerende kapitalgrundlag — resterende supplerende kapital — overført til efterfølgende periode | Saldo for supplerende kapitalgrundlag for resterende supplerende kapital, overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |
| R1200/C0010 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Overført fra foregående periode | Saldo for samlet supplerende kapitalgrundlag overført fra den foregående indberetningsperiode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R1200/C0110 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Nyt beløb gjort tilgængelige | Nyt supplerende kapitalgrundlag for supplerende kapital, som skal gøres tilgængeligt i indberetningsperioden. |
| R1200/C0120 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Fald i til rådighed stående beløb | Faldet i til rådighed stående samlet supplerende kapitalgrundlag i indberetningsperioden. |
| R1200/C0130 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Indkaldt som basiskapitalgrundlag | Samlet supplerende kapitalgrundlag indkaldt som basiskapitalgrundlagselement i indberetningsperioden. |
| R1200/C0060 | Samlet supplerende kapitalgrundlag — Overført til efterfølgende periode | Saldo for samlet supplerende kapitalgrundlag overført til den efterfølgende indberetningsperiode. |

S.23.04 — Liste over kapitalgrundlagselementer

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning for koncerner, uanset hvilken metode der anvendes til beregning af koncernsolvensen.

Dette skema skal indberettes, hvis beløbet for kapitalgrundlaget for kernekapital (tier 1), supplerende kapital (tier 2) og resterende supplerende kapital (tier 3) ændres med mere end 5 % i forhold til det foregående år beregnet som nedenfor.

$$\% \text{ - ændring } (T; T - 1) := \frac{\text{Available Own funds in tier } i \text{ to cover SCR in } T}{\text{Available Own funds in tier } i \text{ to cover SCR in } T - 1}$$

I tilfælde af ikke til rådighed stående kapitalgrundlagsposter finder tærsklen ikke anvendelse, og hele skemaet skal indberettes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0010 | Beskrivelse af efterstillede gensidige medlemskonti | En liste over efterstillede gensidige medlemskonti for en koncern. |
| C0020 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Beløb (i indberetningsvalutaen) | Værdi af individuelle efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0030 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Tier | Angivelse af tier for de efterstillede gensidige medlemskonti. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Kernekapital 2 — Kernekapital — ubegrænset 3 — Kernekapital — begrænset 4 — Supplerende kapital 5 — Resterende supplerende kapital |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0040 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. Den oprindelige valuta. |
| C0050 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Udstedende enhed | Angiv, om den enhed, der udsteder de efterstillede gensidige medlemskonti, tilhører koncernen som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Tilhører samme koncern 2 — Tilhører ikke samme koncern |
| C0060 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Långiver (hvis specifik) | Angiv långiveren for de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0070 | Efterstillede gensidige medlemskonti — jf. overgangsbestemmelser? | Hermed angives, hvorvidt de efterstillede gensidige medlemskonti er omfattet af overgangsbestemmelserne. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne 2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne |
| C0080 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Modpart (hvis specifik) | Angiv modparten for de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0090 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for de efterstillede gensidige medlemskonti. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0100 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Udløbsdato | Udløbsdatoen for de efterstillede gensidige medlemskonti. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0110 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Første indløsningsdato | Datoen for første indløsning af de efterstillede gensidige medlemskonti. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0120 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Oplysninger om senere indløsninger | Datoerne for senere indløsninger af de efterstillede gensidige medlemskonti. |
| C0130 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Oplysninger om incitament til at indløse | Incitamenterne til indløsning af de efterstillede gensidige medlemskonti. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0140 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Varselsperiode | Varsel vedrørende de efterstillede gensidige medlemskonti. Datoen angives her i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0150 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse | Navnet på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse, med land angivet i parentes. |
| C0160 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Tilbagekøb i årets løb | Redegørelse for, hvorvidt elementet er blevet tilbagekøbt i årets løb. |
| C0170 | Efterstillede gensidige medlemskonti — % af udstedelsen, der besiddes af enheder i koncernen | Den procentsats af udstedelser af efterstillede gensidige medlemskonti, der besiddes af enheder, der tilhører koncernen som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. |
| C0180 | Efterstillede gensidige medlemskonti — Bidrag til koncernens efterstillede gensidige medlemskonti | Bidraget fra de efterstillede gensidige medlemskonti til koncernens efterstillede gensidige medlemskonti i alt. |
| C0190 | Beskrivelse af præferenceaktier | Angivelse af individuelle præferenceaktier. |
| C0200 | Præferenceaktier — Værdi | Værdien af præferenceaktierne. |
| C0210 | Præferenceaktier — Omfattet af overgangsbestemmelserne? | Angivelse af, hvorvidt præferenceaktierne er omfattet af overgangsbestemmelserne. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne 2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne |
| C0220 | Præferenceaktier — Modpart (hvis specifik) | Angivelse af indehaveren af præferenceaktierne, hvis begrænset til en enkelt part. Hvis aktierne udstedes bredt, angives intet. |
| C0230 | Præferenceaktier — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for præferenceaktierne. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0240 | Præferenceaktier — Første indløsningsdato | Datoen for første indløsning af præferenceaktierne. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0250 | Præferenceaktier — Oplysninger om senere indløsninger | Datoerne for senere indløsninger af præferenceaktierne. |
| C0260 | Præferenceaktier — Oplysninger om incitamenter til at indløse | Incitamenterne til indløsning af præferenceaktierne. |
| C0270 | Beskrivelse af efterstillet gæld | Her opføres de enkelte efterstillede forpligtelser for en koncern. |
| C0280 | Efterstillet gæld — Værdi | Værdi af den efterstillede gæld. |
| C0290 | Efterstillet gæld — Tier | Angivelse af tier for den efterstillede gæld. |
| C0300 | Efterstillet gæld — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. |
| C0311 | Efterstillet gæld — Udstedende enhed | Angiv koden for den enhed, der udsteder den efterstillede gæld, og som tilhører koncernen som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. |
| C0320 | Efterstillet gæld — Långiver (hvis specifik) | Angivelse af långiver for den efterstillede gæld, hvis specifik. Hvis ikke specifik, indberettes denne post ikke. |
| C0330 | Efterstillet gæld — Omfattet af overgangsbestemmelserne? | Her angives, hvorvidt den efterstillede gæld er omfattet af overgangsbestemmelserne. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af overgangsbestemmelserne 2 — Ikke omfattet af overgangsbestemmelserne |
| C0340 | Efterstillet gæld — Modpart for den efterstillede gæld — (hvis specifik) | Her anføres den modpart for de efterstillede forpligtelser, som tilhører koncernen jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. Hvis ikke specifik, indberettes denne post ikke. Denne kolonne er forbeholdt eventuelle interne långivere. |
| C0350 | Efterstillet gæld — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0360 | Efterstillet gæld — Forfaldsdato | Forfaldsdatoen for den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0370 | Efterstillet gæld — Første indløsningsdato | Datoen for første fremtidige indløsning af den efterstillede gæld. Den angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0380 | Efterstillet gæld — Senere indløsningsdatoer | Datoerne for senere indløsninger af den efterstillede gæld. |
| C0390 | Efterstillet gæld — Oplysninger om incitamenter til at indløse | Oplysninger om incitamenterne til indløsning af den efterstillede gæld. |
| C0400 | Efterstillet gæld — Varselsperiode | Varsel vedrørende den efterstillede gæld. Datoen angives her i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0430 | Efterstillet gæld — % af udstedelsen, der besiddes af enheder i koncernen | Den procentsats af udstedelser, der besiddes af modparter, der tilhører koncernen som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. |
| C0440 | Efterstillet gæld — Bidrag til koncernens efterstillede gæld | Efterstillet gæld, som er medtaget i den samlede efterstillede gæld på koncernniveau, og det bidrager til koncernens kapitalgrundlag. |
| C0450 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden | Angivelse af de andre individuelle emner godkendt af tilsynsmyndigheden for et individuelt selskab. |
| C0460 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Beløb | Beløbet vedrørende andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden |
| C0470 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Valutakode | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen. |
| C0480 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — kernekapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for kernekapitalelementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0490 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — supplerende kapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for supplerende kapitalelementer. |
| C0500 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — resterende supplerende kapital | Andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden, som opfylder kriterierne for resterende supplerende kapital. |
| C0510 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Dato for tilladelse | Datoen for tilladelsen vedrørende andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0520 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden –Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet for andre, ikke ovenfor angivne basiskapitalgrundlagselementer | Navnet på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse, med land angivet i parentes. |
| C0530 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Navn på den pågældende enhed | Her angives navnet på den pågældende enhed. |
| C0540 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — Tilbagekøb i løbet af året | Redegørelse for, hvorvidt elementet er blevet tilbagekøbt. |
| C0550 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden — % af udstedelsen, der besiddes af enheder i koncernen | Den procentsats af udstedelser, der besiddes af enheder, der tilhører koncernen som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF. |
| C0560 | Andre, ikke ovenfor angivne elementer godkendt som basiskapitalgrundlag af tilsynsmyndigheden –Bidrag til koncernens andre basiskapitalgrundlagselementer | Bidraget fra andre individuelle elementer godkendt af tilsynsmyndigheden til koncernens andre basiskapitalgrundlagselementer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0570 | Kapitalgrundlagselementer jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — Beskrivelse af elementet | Denne celle skal indeholde en beskrivelse af de kapitalgrundlagselementer jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II. |
| C0580 | Kapitalgrundlag jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II — I alt | Det samlede beløb vedrørende de kapitalgrundlagselementer jf. regnskabet, som ikke må medregnes i afstemningsreserven, og som ikke opfylder kriterierne for klassificering som kapitalgrundlag i henhold til Solvens II. |
| C0590 | Supplerende kapitalgrundlag — Beskrivelse af supplerende kapitalgrundlag | Oplysninger om ethvert supplerende kapitalgrundlag for et individuelt selskab. |
| C0600 | Supplerende kapitalgrundlag — Beløb | Værdi af ethvert supplerende kapitalgrundlag. |
| C0610 | Supplerende kapitalgrundlag — Modpart | Modparten for ethvert supplerende kapitalgrundlag. |
| C0620 | Supplerende kapitalgrundlag — Udstedelsesdato | Udstedelsesdatoen for ethvert supplerende kapitalgrundlag. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0630 | Supplerende kapitalgrundlag — Dato for tilladelse | Datoen for tilladelse vedrørende ethvert supplerende kapitalgrundlag. Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd). |
| C0640 | Supplerende kapitalgrundlag — Navn på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse | Navnet på den tilsynsmyndighed, der har givet tilladelse, med land angivet i parentes. |
| C0650 | Supplerende kapitalgrundlag — Navn på den pågældende enhed | Navnet på enheden i forbindelse med det supplerende kapitalgrundlag. |

Justering for ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0660 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Nummer | Identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| C0670 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Teoretisk solvenskapitalkrav | Det teoretiske solvenskapitalkrav for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje. |
| C0680 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Teoretisk solvenskapitalkrav (negative resultater sat til nul) | Det teoretiske solvenskapitalkrav. Negative værdier indberettes som nul. |
| C0690 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Overskydende aktiver i forhold til passiver | Overskydende aktiver i forhold til passiver for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje. Denne værdi skal afspejle fradrag af fremtidige overførsler til aktionærer. |
| C0700 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje — Fremtidige overførsler til aktionærer | Værdi af fremtidige overførsler til aktionærer, jf. artikel 80, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0710 | Ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer — Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Frdraget vedrørende hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje i henhold til artikel 81 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

Frdrag vedrørende ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer

| | | |
|-------------|---|---|
| C0970/R0010 | Ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer — Justering for begrænsede kapitalgrundlagselementer i forbindelse med matchtilpasningsporteføljer og ring-fenced fonde | Det samlede frdrag vedrørende ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer, der er indberettet under C0710. |
|-------------|---|---|

Beregning af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau (skal beregnes selskab for selskab)

Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag på koncernniveau — Som overstiger bidraget udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav

| | | |
|-------|---|-----------------|
| C0720 | Tilknyttede (gen)forsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber, blandede finansielle holdingselskaber, accessoriske servicevirksomheder og SPV'er omfattet af koncernberegningen | Navn på selskab |
|-------|---|-----------------|

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0730 | Land | ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor enhedens har hovedsæde. |
| C0740 | Bidrag udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav | <p>Bidrag udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav.</p> <p>Hvis metode 1 anvendes, skal et datterselskabs bidrag til koncernen beregnes efter formlen:</p> $\text{Contr}_j = \text{SCR}_j \times \text{SCR}^{\text{fully consolidated diversified}} / \sum_i \text{SCR}_i^{\text{solo}}$ <p>hvor:</p> <ul style="list-style-type: none"> — $\text{SCR}_i^{\text{solo}}$ er solvenskapitalkravet på for det enkelte selskab (SCR solo) for moderselskabet og det enkelte forsikringselskab, genforsikringselskab, mellemliggende forsikringsholdingselskab og blandede finansielle holdingselskab, over hvilke der udøves en bestemmende indflydelse, og som er omfattet af det fuldt ud konsoliderede solvenskapitalkrav — SCR_j er solvenskapitalkravet for det enkelte selskab for enheden j — andelen er den proportionale justering som følge af indregningen af diversifikationseffekter i den del, der er fuldt ud konsolideret; værdien af andelen er begrænset til 1. <p>Vurderingen af det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag skal også foretages for kapitalgrundlag i ikkekontrollerede selskaber under hensyn til proportionalitetsprincippet.</p> <p>For metode 2 er det tilknyttede selskabs bidrag til koncernens solvenskapitalkrav den forholdsmæssige andel af det individuelle solvenskapitalkrav.</p> |
| C0760 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndighed | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndighed |
| C0770 | Ikke til rådighed stående overskudskapital | Ikke til rådighed stående overskudskapital på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0780 | Ikke til rådighed stående indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital | Ikke til rådighed stående indkaldt, men endnu ikke indbetalt kapital på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0790 | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0800 | Ikke til rådighed stående efterstillede gensidige medlemskonti | Ikke til rådighed stående efterstillede gensidige medlemskonti på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0810 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier | Ikke til rådighed stående præferenceaktier på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0820 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0830 | Et beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto | Ikke til rådighed stående beløb, som svarer til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0840 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier på koncernniveau i både EØS-enheder og ikke-EØS-enheder (artikel 222, stk. 2-5, i direktiv 2009/138/EF og artikel 330, stk. 3, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0841 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i afstemningsreserven | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i tilknytning til kapitalgrundlag i afstemningsreserven |
| C0842 | Samlet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag | Det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt opgjort efter vurderingen på koncernniveau af, hvad der er til rådighed, jf. artikel 222, stk. 4, i direktiv 2009/138/EF, det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt beregnet selskab for selskab ved sammenlægning af kapitalgrundlag, jf. artikel 222, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF (f.eks. overskudskapital og tegnet, men endnu ikke indbetalt kapital), og jf. artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35 (f.eks. supplerende kapitalgrundlag, præferenceaktier, efterstillede gensidige medlemskonti, efterstillede forpligtelser og værdien af udskudte skatteaktiver, opgjort netto). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0850 | Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes | <p>Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes på koncernniveau.</p> <p>I overensstemmelse med artikel 222, stk. 4, i direktiv 2009/138/EF, det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt beregnet selskab for selskab ved sammenlægning af kapitalgrundlag, jf. artikel 222, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF (f.eks. overskudskapital og tegnet, men endnu ikke indbetalt kapital), og jf. artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35 (f.eks. supplerende kapitalgrundlag, præferencaktier, efterstillede gensidige medlemskonti, efterstillede forpligtelser og værdien af udskudte skatteaktiver, opgjort netto).</p> <p>Den del af et sådant kapitalgrundlag, der overstiger bidraget fra det tilknyttede selskab til koncernens solvenskapitalkrav, kan ikke anses for at være til rådighed til opfyldelse af koncernens solvenskapitalkrav.</p> <p>Hvis det samlede beløb for et sådant kapitalgrundlag i C0842 ikke overstiger bidraget fra det tilknyttede selskab til koncernens solvenskapitalkrav, er dette fradrag i C0850 ikke nødvendigt som en del af beregningen.</p> |
| C0851 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser | Minoritetsinteresser på koncernniveau, når metode 1 anvendes, i et datterselskab i og uden for EØS af (gen)forsikringselskaber, forsikringsholdingselskaber, blandede finansielle holdingselskaber eller accessoriske servicevirksomheder (artikel 330, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35). |
| C0750 | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag | Ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag, når metode 1 anvendes, dvs. minoritetsinteresser i anerkendt kapitalgrundlag (efter indregning af fradrag af ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i C0850) for (gen)forsikringsdatterselskabet, som overstiger bidraget fra det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav. (artikel 330, stk. 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35) |
| C0870 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndighed | Den samlede værdi for ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende andre kapitalgrundlagselementer godkendt af tilsynsmyndighed på koncernniveau. |
| C0880 | Ikke til rådighed stående overskudskapital | Det samlede beløb for ikke til rådighed stående overskudskapital på koncernniveau. |
| C0890 | Ikke til rådighed stående indkaldt, men ikke indbetalt kapital | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed stående indkaldt, men ikke indbetalt kapital på koncernniveau. |
| C0900 | Ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed stående supplerende kapitalgrundlag på koncernniveau. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0910 | Ikke til rådighed stående efterstillede gensidige medlemskonti | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed stående efterstillede gensidige medlemskonti på koncernniveau. |
| C0920 | Ikke til rådighed stående præferenceaktier | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed stående præferenceaktier på koncernniveau. |
| C0930 | Ikke til rådighed stående efterstillet gæld | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed efterstillet gæld på koncernniveau. |
| C0940 | Et beløb svarende til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto | Det samlede overordnede beløb, som svarer til værdien af ikke til rådighed stående udskudte skatteaktiver netto på koncernniveau. |
| C0950 | Ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier | Den samlede overordnede værdi af ikke til rådighed stående overkurs ved emission vedrørende præferenceaktier på koncernniveau. |
| C0951 | Ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i afstemningsreserven | Den samlede værdi for ikke til rådighed stående kapitalgrundlag vedrørende kapitalgrundlag i afstemningsreserven på koncernniveau. |
| C0962 | Samlet ikke til rådighed stående kapitalgrundlag | Det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt opgjort efter vurderingen på koncernniveau af, hvad der er til rådighed, jf. artikel 222, stk. 4, i direktiv 2009/138/EF, det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt beregnet selskab for selskab ved sammenlægning af kapitalgrundlag, jf. artikel 222, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF (f.eks. overskudskapital og tegnet, men endnu ikke indbetalt kapital), og jf. artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35 (f.eks. supplerende kapitalgrundlag, præferenceaktier, efterstillede gensidige medlemskonti, efterstillede forpligtelser og værdien af udskudte skatteaktiver, opgjort netto). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0960 | Samlede ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes | <p>Det samlede beløb for ikke til rådighed stående kapitalgrundlag, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag.</p> <p>I overensstemmelse med artikel 222, stk. 4, i direktiv 2009/138/EF, det ikke til rådighed stående kapitalgrundlag i alt beregnet selskab for selskab ved sammenlægning af kapitalgrundlag, jf. artikel 222, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF (f.eks. overskudskapital og tegnet, men endnu ikke indbetalt kapital), og jf. artikel 330 i delegeret forordning (EU) 2015/35 (f.eks. supplerende kapitalgrundlag, præferencaktier, efterstillede gensidige medlemskonti, efterstillede forpligtelser og værdien af udskudte skatteaktiver, opgjort netto).</p> <p>Den del af et sådant kapitalgrundlag, der overstiger bidraget fra det tilknyttede selskab til koncernens solvenskapitalkrav, kan ikke anses for at være til rådighed til opfyldelse af koncernens solvenskapitalkrav.</p> <p>Hvis det samlede beløb for et sådant kapitalgrundlag i C0842 ikke overstiger bidraget fra det tilknyttede selskab til koncernens solvenskapitalkrav, er dette fradrag i C0850 ikke nødvendigt som en del af beregningen.</p> |
| C0861 | Minoritetsinteresser | Det samlede beløb for minoritetsinteresser på koncernniveau. |
| C0860 | Minoritetsinteresser, der skal fratrækkes koncernens kapitalgrundlag | Det samlede beløb for ikke til rådighed stående minoritetsinteresser, der skal fratrækkes på koncernniveau. |

S.25.01 — Solvenskapitalkrav — For koncerner, der anvender standardformlen

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.25.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i skema S.01.03.

Skema SR.25.01 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Såfremt en enhed har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav («nSCR») for risikomoduler samt de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- Såfremt selskabet anvender fuld justering som følge af sammenlægningen for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav, som om der ikke forekom tab ved diversifikation, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikodelmoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav ved en direkte sammenlægning for delmoduler, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav ved en direkte sammenlægning for moduler, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af de tabsabsorberende evner for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0050) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici, skadesforsikringsrisici). Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

$$\text{Calculation of q factor} = \frac{\text{adjustment}}{\text{BSCR}' - \text{nSCR}_{\text{int}}}$$

hvor

| | | | |
|---|----------------------------|---|---|
| — | <i>justering</i> | = | justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder |
| — | BSCR' | = | primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema (C0040/R0100) |
| — | nSCR_{int} | = | teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema (C0040/R0070). |

- Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici, skadesforsikringsrisici).

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indtil R0460 indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne indtil R0460 kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes efter metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| Z0010 | Artikel 112 | <p>Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, i Solvens II med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7</p> <p>2 — Regelmæssig indberetning</p> |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer.</p> |
| R0010–R0050/ C0030 | Nettosolvenskapitalkrav | <p>Nettokapitalkravet for hvert risikomodul beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Forskellen mellem netto- og bruttosolvenskapitalkravet er indregningen af fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I disse celler medregnes fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> |
| R0010–R0050/ C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav | <p>Bruttokapitalkravet for hvert risikomodul beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Forskellen mellem netto- og bruttosolvenskapitalkravet er indregningen af fremtidige diskretionære ydelser, som fastsat i artikel 206 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som fastsat i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I disse celler medregnes fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| R0010–R0050/ C0050 | Fordeling af justering som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer — ring-fenced fonde | En del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt. |
| R0060/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — diversifikation | Det beløb, som afspejler diversifikationseffekter mellem bruttorisikomodulers primære solvenskapitalkrav, herunder diversifikationseffekter i hvert risikomodul, som følge af anvendelsen af den i bilag IV til direktiv 2009/138/EF definerede korrelationsmatrix. Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi. |
| R0060/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Diversifikation | Det beløb, som afspejler diversifikationseffekter mellem bruttorisikomodulers primære solvenskapitalkrav, herunder diversifikationseffekter i hvert risikomodul, som følge af anvendelsen af den i bilag IV til direktiv 2009/138/EF definerede korrelationsmatrix. Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi. |
| R0070/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — risici på immaterielle aktiver | Kapitalkravet for risici på immaterielle aktiver efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. |
| R0070/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Risici på immaterielle aktiver | De fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35, for risici på immaterielle aktiver er nul efter standardformlen, hvorfor R0070/C0040 er lig med R0070/C0030. |
| R0100/C0030 | Nettosolvenskapitalkrav — primært solvenskapitalkrav | Det primære kapitalkrav efter indregning af fremtidige diskretionære ydelser, jf. artikel 206 i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved brug af standardformlen. Beløbet skal i givet fald fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som omhandlet i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF. I denne celle er fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau ikke medregnet. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation. Beløbet beregnes som summen af nettokapitalkravene for hvert risikomodul i standardformlen inklusive justering for diversifikationseffekter i standardformlen. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|---|
| R0100/C0040 | Bruttosolvenskapitalkrav — Primært solvenskapitalkrav | <p>Det primære kapitalkrav før indregning af fremtidige diskretionære ydelser jf. artikel 205 i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Beløbet skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter, som fastsat i artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.</p> <p>I denne celle er fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau ikke medregnet. Tallene viser solvenskapitalkravet, som om der ikke forekom tab ved diversifikation.</p> <p>Beløbet beregnes som summen af bruttokapitalkravene for hvert risikomodul i standardformlen inklusive justering for diversifikationseffekter i standardformlen.</p> |
| <i>Beregning af solvenskapitalkravet</i> | | |
| R0120/C0100 | Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | <p>Justeringer, der skal rette op på skævheder i beregningen af solvenskapitalkravet som følge af aggregering af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på risikomodulniveau.</p> <p>Beløbet skal være positivt.</p> |
| R0130/C0100 | Operationelle risici | Kapitalkravet for modulet for operationelle risici beregnet ved brug af standardformlen. |
| R0140/C0100 | Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | <p>Justeringen for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> <p>For ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og for enheden, såfremt der hverken forekommer ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) eller matchtilpasningsporteføljer, er dette størsteværdien af nul og det beløb, der svarer til mindsteværdien af de forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring og forskellen mellem det primære brutto- og nettosolvenskapitalkrav.</p> <p>Såfremt der forekommer ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) eller matchtilpasningsporteføljer, beregnes dette beløb som summen af de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og den resterende del og med de fremtidige diskretionære nettoydelse som øvre grænse.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0150/C0100 | Udskudte skatters tabsabsorberende evne | Justeringen for udskudte skatters tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. Beløbet skal være negativt. |
| R0160/C0100 | Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | Kapitalkravet, beregnet i henhold til reglerne i artikel 17 i direktiv 2003/41/EF, for ring-fenced fonde vedrørende pensionsaktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF, for hvilke der gælder overgangsforanstaltninger. Posten skal kun indberettes i overgangsperioden. |
| R0200/C0100 | Solvenskapitalkrav beregnet på grundlag af artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive kapitaltillæg | Solvenskapitalkravet, før et eventuelt kapitaltillæg, beregnet i overensstemmelse med artikel 336, litra a), dvs. på grundlag af konsoliderede data som omhandlet i artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, herunder data fra kontrollerede kollektive investeringsinstitutter og investeringer pakket som fonde. |
| R0210/C0100 | Allerede indførte kapitaltillæg | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0211/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller senere indregnes ikke. |
| R0212/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller senere indregnes ikke. |
| R0213/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller senere indregnes ikke. |
| R0214/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller senere indregnes ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0220/C0100 | Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau | <p>Beløbet for solvenskapitalkravet for selskaber omfattet af metode 1 som defineret i artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Den skal indeholde alle komponenter af det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau, solvenskapitalkravet beregnet på grundlag af de konsoliderede data (R0200), herunder kapitaltillæg (R0210), inklusive kapitalkrav for selskaber fra andre finansielle sektorer (R0500), kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber (R0540), kapitalkrav for resterende selskaber (R0550) og kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde (R0555).</p> |
| <i>Andre oplysninger om solvenskapitalkravet</i> | | |
| R0400/C0100 | Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | Kapitalkravet for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici. |
| R0410/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | De teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del, såfremt koncernen har ring-fenced fonde. |
| R0420/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle ring-fenced fonde, såfremt selskabet har ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som vedrører aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF (overgangsforanstaltninger)). |
| R0430/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle matchtilpasningsporteføljer. |
| R0440/C0100 | Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | Justeringen for en diversifikationseffekt mellem ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, og den resterende del, hvis det er relevant. |
| R0450/C0100 | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | <p>Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Fuldstændig genberegning 2 — Forenkling på risikodelmodulniveau 3 — Forenkling på risikomodulniveau 4 — Ingen justering <p>Såfremt koncernen ikke har ring-fenced fonde (eller kun har ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF), vælger den mulighed 4.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0460/C0100 | Fremtidige diskretionære nettoydelse | De forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring. |
| R0470/C0100 | Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav | Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav som omhandlet i artikel 230 i direktiv 2009/138/EF. |
| R0500/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer. R0500 forventes at være lig med summen af R0510, R0520 og R0530. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter et selskab, som er underlagt ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav, f.eks. en bank, og svarer til kapitalkravet beregnet i overensstemmelse med de gældende krav. |
| R0510/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Kreditinstitutter, investeringselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrationselskaber | Kapitalkrav for kreditinstitutter, investeringselskaber og finansieringsinstitutter. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er kreditinstitutter, investeringselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrationselskaber, og de er underlagt kapitalkrav, beregnet i overensstemmelse med de relevante sektorbestemte regler. |
| R0520/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser | Kapitalkrav for arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, og de er underlagt ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav, beregnet i overensstemmelse med de relevante sektorbestemte regler. |
| R0530/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter | Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter. Beløbet er et teoretisk solvenskrav, der beregnes, som hvis de relevante sektorbestemte regler skulle anvendes. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0540/C0100 | Kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrolerede selskaber | Den forholdsmæssige andel af solvenskapitalkravene for de tilknyttede forsikrings- og genforsikringsselskaber og forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, som ikke er datterselskaber, jf. artikel 336, stk. 1, litra b), i delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau og svarer for de enheder, som ikke er datterselskaber, til kapitalkravet beregnet i overensstemmelse med Solvens II. |
| R0550/C0100 | Kapitalkrav for resterende selskaber | Dette beregnes i henhold til artikel 336, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0555/C0100 | Kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde | Beløbet beregnes i henhold til artikel 336, stk. 1, litra e), i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0560/C0100 | Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering. | Solvenskapitalkravet for selskaber omfattet af metode 2 som defineret i artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, når der anvendes en kombination af metoder. |
| R0570/C0100 | Koncernens samlede solvenskapitalkrav | Samlede solvenskapitalkrav for samtlige selskaber, uanset anvendt metode. Det samlede solvenskapitalkrav for koncernen forventes at være lig med summen af R0220 og R0560. Hvis det konsoliderede minimumskapitalkrav på koncernniveau (R0470) overstiger det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (R0220), forventes det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau at være lig med summen af R0470 og R0560. |

S.25.05 — Solvenskapitalkrav — for koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Generelle bemærkninger:

Dette bilag indeholder yderligere vejledning vedrørende skemaerne i bilag I til denne forordning. I første kolonne i efterfølgende tabel er angivet de poster, som skal indberettes, idet kolonnerne og rækkerne er anført som vist i skemaet i bilag I.

Dette bilag vedrører den indledende og årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

Formålet med dette skema er at indsamle data på aggregeret niveau og vise diversificeringsfordelene mellem separate risikomoduler. Alle værdier indberettes inden den skattemæssige virkning, medmindre andet er anført.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indtil R0470 (S.25.05.04.02) gælder, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne indtil R0470 (S.25.05.04.02) kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes efter metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.

Skema SR.25.05 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Partiel intern model

Alle rækker for C0010 henviser til kapitalkravet for hver komponent uanset beregningsmetode (enten standardformel eller partiel intern model) efter justeringer for forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne, i det omfang de er indeholdt i beregningen af komponenterne.

For komponenterne forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne bør den tabsabsorberende evne anføres, når disse offentliggøres som særskilte komponenter (disse beløb bør offentliggøres som negative beløb).

For komponenter beregnet ved brug af standardformlen anføres i denne celle det teoretiske bruttosolvenskapitalkrav. For komponenter beregnet ved brug af den partielle interne model anføres her den værdi, som indregner fremtidige ledelseshandlinger indeholdt i beregningen, men ikke sådanne, som modelleres som en særskilt komponent.

Beløbene skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.

I givet fald medregnes i disse felter ikke fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af de teoretiske solvenskapitalkrav på enhedsniveau for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer.

Skema SR.25.05 indberettes for ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og den resterende del for hver koncern under en partiel intern model. Dette omfatter selskaber, hvor en partiel intern model anvendes på en ring-fenced fond og/eller matchtilpasningsportefølje i sin helhed, mens de øvrige ring-fenced fonde og/eller matchtilpasningsporteføljer anvender standardformlen. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

For sådanne koncerner under en partiel intern model, hvor justering som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer er relevant i tilfælde, hvor enheden har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav på risikomodulniveau samt de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- såfremt selskabet anvender den fulde justering som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau: De teoretiske solvenskapitalkrav beregnes, som om der ikke var ring-fenced fonde, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af den tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og resterende del.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikodelmoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for delmoduler.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for moduler.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0050) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici), når den beregnes efter standardformlen. Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

- Beregning af »q faktor« $= \frac{\text{justering}}{BSCR' - nSCR_{int}}$, hvor
 - *justering* = justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder
 - *BSCR'* = primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema
 - *nSCR_{int}* = teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema
- Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici).

Komplet intern model

Skema SR 25.05 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del for hver koncern under en komplet intern model. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. Hvis post Z0020 = 2, indberet »0«. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0020 | Samlet beløb for diversifikation | Beløbet for diversifikationseffekter mellem risikomoduler Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0030 | Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | Diversificeret kapitalkrav før skat. Det samme som S.26.08.04 C0010/R0030 |
| C0010/R0040 | Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | Diversificeret kapitalkrav efter skat. Det samme som S.26.08.04 C0010/R0040 |
| C0010/R0070 | Samlet markeds- og kreditrisiko | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0070 |
| C0010/R0080 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0080 |
| C0010/R0190 | Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0190 |
| C0010/R0200 | Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0200 |
| C0010/R0270 | Samlet virksomhedsrisiko | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0270 |
| C0010/R0280 | Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0280 |
| C0010/R0310 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0310 |
| C0010/R0320 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0320 |
| C0010/R0400 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0400 |
| C0010/R0410 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0410 |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0010/R0480 | Samlet operationel risiko | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0480 |
| C0010/R0490 | Samlet operationel risiko — diversificeret | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0490 |
| C0010/R0500 | Andre risici | Det samme som S.26.08.04 C0010/R0500 |
| C0050/R0020-R0530 | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, en del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul og delmodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |
| C0060/R0020-R0530 | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Med henblik på at angive, hvorvidt de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i beregningen. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes: 1 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 2 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 3 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 4 — Ingen indeholdt indregning af fremtidige ledelseshandlinger. |
| C0070/R0020-R0530 | Modelleret beløb | For hver komponent anføres i denne celle beløbet som beregnet ved brug af den partielle interne model. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |
| R0110/C0100 | Ikkediversificerede komponenter i alt | Summen af alle komponenter. |
| R0060/C0100 | Diversifikation | Det samlede beløb vedrørende diversifikationen mellem komponenter, jf. C0030. Beløbet indeholder ikke diversifikationseffekter inden for hver komponent, som skal være indeholdt i de i C0030 indberettede beløb. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| R0120/C0100 | Justering som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, den justering på risikomodul-niveau, der skal korrigere for bias i beregningen af solvenskapitalkravet som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0160/C0100 | Kapitalkrav for aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF | Kapitalkravet, beregnet i henhold til reglerne i artikel 17 i direktiv 2003/41/EF, for ring-fenced fonde vedrørende pensionsaktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF, for hvilke der gælder overgangsforanstaltninger. Posten skal kun indberettes i overgangsperioden. |
| R0200/C0100 | Solvenskapitalkrav beregnet på grundlag af artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35, eksklusive kapitaltillæg | Solvenskapitalkravet, før et eventuelt kapitaltillæg, beregnet i overensstemmelse med artikel 336, litra a), dvs. på grundlag af konsoliderede data som omhandlet i artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, herunder data fra kontrollerede kollektive investeringsinstitutter og investeringer pakket som fonde. |
| R0210/C0100 | Allerede indførte kapitaltillæg | Kapitaltillæg indført frem til referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden indregnes ikke. |
| R0211/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type a) | Beløbet for kapitaltillæg af type a), i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF (2014/51/EU), og som var fastsat på referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller senere indregnes ikke. |
| R0212/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type b) | Beløbet for kapitaltillæg af type b), i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF (2014/51/EU), og som var fastsat på referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller efter oplysningernes indberetning indregnes ikke. |
| R0213/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type c) | Beløbet for kapitaltillæg af type c), i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF (2014/51/EU), og som var fastsat på referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller efter oplysningernes indberetning indregnes ikke. |
| R0214/C0100 | Heraf allerede indførte kapitaltillæg — artikel 37, stk. 1, type d) | Beløbet for kapitaltillæg af type d), i overensstemmelse med artikel 37, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF (2014/51/EU), og som var fastsat på referencedatoen for indberetningen. Kapitaltillæg indført mellem nævnte dato og datoen for indberetning af oplysningerne til tilsynsmyndigheden eller efter oplysningernes indberetning indregnes ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0220/C0100 | Konsolideret solvenskapitalkrav på koncernniveau | Samlet solvenskapitalkrav inklusive kapitaltillæg for selskaber omfattet af metode 1 som defineret i artikel 230 i direktiv 2009/138/EF. Heri medregnes alle komponenter af det konsoliderede solvenskapitalkrav, inklusive kapitalkrav for selskaber fra andre finansielle sektorer, kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrollerede selskaber, kapitalkrav for resterende selskaber og kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter og investeringer pakket som fonde. |

Andre oplysninger om solvenskapitalkravet

| | | |
|-------------|---|---|
| R0300/C0100 | Beløb/estimat vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers samlede tabsabsorberende evne | Beløb/estimat vedrørende den samlede justering for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne, heri medregnet den del, der er indeholdt i komponenterne, og den del, der offentliggøres som en særskilt komponent. Beløbet indberettes som en negativ værdi. |
| R0310/C0100 | Beløb/estimat vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne | Beløb/estimat vedrørende den samlede justering for udskudte skatter, heri medregnet den del, der er indeholdt i komponenterne, og den del, der offentliggøres som en særskilt komponent. Beløbet indberettes som en negativ værdi. |
| R0400/C0100 | Kapitalkrav for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici | Beløbet for kapitalkravet for delmodulet for løbetidsbaserede aktierisici. Finder kun anvendelse på partielle interne modeller. |
| R0410/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del | De teoretiske solvenskapitalkrav for den resterende del, såfremt selskabet har ring-fenced fonde. |
| R0420/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle ring-fenced fonde, såfremt selskabet har ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som vedrører aktiviteter omfattet af artikel 4 i direktiv 2003/41/EF (overgangsforanstaltninger)). |
| R0430/C0100 | Samlede teoretiske solvenskapitalkrav for matchtilpasningsporteføljer | Summen af de teoretiske solvenskapitalkrav for alle matchtilpasningsporteføljer. Denne post indberettes ikke ved indberetning af solvenskravsregninger for ring-fenced fonde eller matchtilpasningsporteføljer. |
| R0440/C0100 | Diversifikationseffekter som følge af aggregering af teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde med henblik på artikel 304 | Justeringen for en diversifikationseffekt mellem ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, og den resterende del, hvis det er relevant. Beløbet skal svare til forskellen mellem summen af det teoretiske solvenskapitalkrav for hver ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/den resterende del og det i R0200/C0100 indberettede solvenskapitalkrav. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0450/C0100 | Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde | <p>Metode anvendt til beregning af justeringen som følge af sammenlægning teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde. En af følgende valgmuligheder anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Fuldstændig genberegning 2 — Forenkling på risikodelmodulniveau 3 — Forenkling på risikomodulniveau 4 — Ingen justering <p>Såfremt selskabet ikke har ring-fenced fonde (eller kun har ring-fenced fonde, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF), vælger det mulighed 4.</p> <p>Finder kun anvendelse på partielle interne modeller.</p> |
| R0460/C0100 | Fremtidige diskretionære nettoydelse | De forsikringsmæssige hensættelser uden risikomargin for fremtidige diskretionære ydelser efter fradrag af genforsikring. |
| R0470/C0100 | Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav | Koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav som omhandlet i artikel 230 i direktiv 2009/138/EF. Denne post er kun relevant for indberetning på koncernniveau. |
| R0500/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) | <p>Kapitalkrav for andre finansielle sektorer.</p> <p>Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter et selskab, som er underlagt ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav, f. eks. en bank, og svarer til kapitalkravet beregnet i overensstemmelse med de gældende krav.</p> |
| R0510/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Kreditinstitutter, investeringsselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrations-selskaber | <p>Kapitalkrav for kreditinstitutter, investeringsselskaber og finansieringsinstitutter.</p> <p>Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er kreditinstitutter, investeringsselskaber og finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde og UCITS-administrations-selskaber, og de er underlagt kapitalkrav, beregnet i overensstemmelse med de relevante sektorbestemte regler.</p> |
| R0520/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser | <p>Kapitalkrav for arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser.</p> <p>Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, og de er underlagt ikkeforsikringsmæssige kapitalkrav, beregnet i overensstemmelse med de relevante sektorbestemte regler.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0530/C0100 | Kapitalkrav for andre finansielle sektorer (ikke-forsikringsmæssige kapitalkrav) — Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter | Kapitalkrav for ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter. Beløbet er et teoretisk solvenskrav, der beregnes, som hvis de relevante sektorbestemte regler skulle anvendes. Denne post anvendes kun i forbindelse med indberetning på koncernniveau, når koncernen omfatter selskaber, som er ikkeregulerede enheder, der udøver finansielle aktiviteter. |
| R0540/C0100 | Kapitalkrav for kapitalinteresser i ikkekontrolerede selskaber | Den forholdsvise andel af solvenskapitalkravene for tilknyttede forsikrings- eller genforsikringselskaber og forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, som ikke er datterselskaber. |
| R0550/C0100 | Kapitalkrav for resterende selskaber | Dette beregnes i henhold til artikel 336, stk. 1, litra d), i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0555/C0100 | Kapitalkrav for kollektive investeringsinstitutter eller investeringer pakket som fonde | Beløbet beregnes i henhold til artikel 336, stk. 1, litra e), i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0560/C0100 | Solvenskapitalkrav for selskaber omfattet af metoden med fradrag og aggregering. | Solvenskapitalkravet for selskaber omfattet af metode 2 som defineret i artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, når der anvendes en kombination af metoder. |
| R0570/C0100 | Koncernens samlede solvenskapitalkrav | Samlede solvenskapitalkrav for samtlige selskaber, uanset anvendt metode. Det samlede solvenskapitalkrav for koncernen forventes at være lig med summen af R0220 og R0560. Hvis det konsoliderede minimumskapitalkrav på koncernniveau (R0470) overstiger det konsoliderede solvenskapitalkrav på koncernniveau (R0220), forventes det samlede solvenskapitalkrav på koncernniveau at være lig med summen af R0470 og R0560. |

S.26.01 — Solvenskapitalkrav — Markedsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema S.26.01 udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema S.26.01 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal beløbet for forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølge eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølge eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølge 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølge. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0012/C0010 | Forenklinger — Kreditspændrisici på obligationer og lån | Valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 104 2 — Forenklinger med henblik på artikel 105a 9 — Forenklinger ikke anvendt Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt. Hvis R0012/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0410. |
| R0014/C0010 | Forenklinger — Markedskoncentrationsrisici — forenklinger anvendt | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Forenklinger med henblik på artikel 105a 9 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0020/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — Renterisici | Angiv, hvorvidt et captive-selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af renterisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100–R0120 |
| R0030/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — Kreditspændrisici på obligationer og lån | Angiv, hvorvidt et captive-selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af kreditspændrisici på obligationer og lån. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0040/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — markeds-koncentrationsrisici | Angiv, hvorvidt et captive-selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af markeds-koncentrationsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| | <i>Renterisici</i> | |
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Renterisici | <p>Nettokapitalkravet for renterisici, dvs. efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for renterisici, beregnet ved hjælp af forenklede beregninger for captive-selskaber, der er omfattet af koncerntilsyn.</p> |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Renterisici | <p>Bruttokapitalkravet for renterisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for renterisici, beregnet ved hjælp af forenklede beregninger for captive-selskaber, der er omfattet af koncerntilsyn.</p> |
| R0110–R0120/ C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Renterisici — Stød i form af rentefald/-stigning | <p>Den samlede værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for renterisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0110–R0120/ C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Renterisici — Stød i form af rentefald/-stigning | <p>Den samlede værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0110–R0120/ C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | <p>Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0110–R0120/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — renterisici — stød i form af rentefald/-stigning | <p>Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for rentefald/-stigninger.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| R0110–R0120/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Renterisici — Stød i form af rentefald/stigning | Nettokapitalkravet for renterisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for renterisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0110–R0120/ C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — renterisici — stød i form af rentefald/stigning | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for renterisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0110–R0120/ C0080 | Absolut værdi efter stød — bruttosolvenskapitalkrav — renterisici — stød i form af rentefald/stigning | Bruttokapitalkravet for renterisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for renterisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| <i>Aktierisici</i> | | |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici | Nettokapitalkravet for aktierisici, dvs. efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici | Bruttokapitalkravet for aktierisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0210/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0210/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------------------|--|---|
| R0210/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — aktierisici — type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0210/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0210/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 1-aktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (for type 1-aktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0210/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 1-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0210/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 1-aktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici for type 1-aktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0221, R0230, R0231, R0240/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 1-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0221, R0230, R0231, R0240/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — Type 1-aktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 1-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0250/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0250/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — aktierisici — type 2-aktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende type 2-aktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0250/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (for type 2-aktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 2-aktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (for type 2-aktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0250/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — aktierisici — type 2-aktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (for type 2-aktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0250/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — Type 2-aktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici for type 2-aktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------------------|---|---|
| R0261, R0270, R0271, R0280/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 2-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0261, R0270, R0271, R0280/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — Type 2-aktier | Den absolutte værdi efter aktiestød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af type 2-aktier). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0020, R0293-R0295/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0291/C0040, R0293-R0295/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0291/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0291/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------------------|---|---|
| R0291/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0291/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0292/C0020, R0296-R0298/ C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0292/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0292/C0040, R0296-R0298/ C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0292/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0292/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Nettokapitalkravet for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier) efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0292/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for aktierisici (vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier). De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0292/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Aktierisici — kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier | Bruttokapitalkravet for aktierisici vedrørende hver kategori af kvalificerede infrastrukturaktier bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsaktier, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| | <i>Ejendomsrisici</i> | |
| R0300/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Ejendomsrisici | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for ejendomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — ejendomsrisici | Værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød af de aktiver, som er følsomme over for ejendomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0300/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Ejendomsrisici | Nettokapitalkravet for ejendomsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0300/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — ejendomsrisici | Den absolutte værdi efter ejendomsstød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for ejendomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Ejendomsrisici | Bruttokapitalkravet for ejendomsrisici, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| | <i>Kreditspændrisici</i> | |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — obligationer og lån | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0410/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Obligationer og lån | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, angiver denne post nettosolvenskapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0410/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Obligationer og lån | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Obligationer og lån | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, angiver denne post bruttosolvenskapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0412/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0412/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0412/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0412/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0412/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Nettokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke. |
| R0412/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0412/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændsrisici — obligationer og lån (bortset fra kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Bruttokapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer og lån, der ikke er kvalificerede infrastrukturinvesteringer og kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0413/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0413/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, udfyldes kun R0410. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0413/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0413/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0413/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes. Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0413/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0413/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturinvesteringer) | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturinvesteringer bortset fra kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke.</p> |
| R0414/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Den oprindelige absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0414/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Den oprindelige absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0414/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter stød.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0414/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0414/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke.</p> |
| R0414/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0414/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — obligationer og lån (kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer) | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på obligationer og lån, der er kvalificerede infrastrukturvirksomhedsinvesteringer, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0412, R0413 og R0414 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0410 udfyldes.</p> <p>Hvis R0012/C0010 = 1 og/eller 2, indberettes denne post ikke.</p> |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici for kreditderivater efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici for kreditderivater, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430–R0440/ C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430–R0440/ C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — kreditspændrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430–R0440/ C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430–R0440/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — kreditderivater — stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430–R0440/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Nettokapitalkravet for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|---|
| R0430-R0440/ C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0430-R0440/ C0080 | Absolutte værdier efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Kreditderivater — Stød i nedad-/opadgående retning for kreditderivater | Bruttokapitalkravet for stød i nedad-/opadgående retning knyttet til kreditspændrisici for kreditderivater, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0450/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0450/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0450/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0450/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0450/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0450/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på securitiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0450/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0461/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0461/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0461/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0461/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0461/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0461/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0461/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — privilegeret STS-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på privilegerede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0462/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0462/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0462/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0462/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Ikke-privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0462/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. |
| R0462/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0462/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — ikke-privilegeret STS-securitisering | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på ikke-privilegerede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. |
| R0480/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuritisering | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0480/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringspositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0480/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — resecuritisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringpositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0480/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringpositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0480/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på resecuritiseringpositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0480/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på resecuritiseringpositioner. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0480/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Resecuritisering | Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på resecuritiseringpositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0481/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0481/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0481/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0481/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Anden securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0481/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0481/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0481/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — anden securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på andre securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0482/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0482/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0482/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0482/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0482/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0482/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0482/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — midlertidig type 1-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på midlertidige type 1-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorbende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0483/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0483/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0483/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0483/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorbende evne) — Kreditspændrisici — Securitiseringspositioner — Garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød og efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorbende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------------|--|---|
| R0483/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Nettokapitalkravet for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| R0483/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Den absolutte værdi efter stød, men før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne af de forpligtelser, som er følsomme over for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er.</p> |
| R0483/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — kreditspændrisici — securitiseringspositioner — garanteret STS-securitisering | <p>Bruttokapitalkravet for kreditspændrisici på garanterede STS-securitiseringspositioner, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne.</p> <p>Denne værdi skal kun indberettes, når opdelingen mellem R0461 og R0483 kan udledes af den metode, der er anvendt til beregningen. Hvis det ikke er muligt at foretage en opdeling, skal kun R0450 udfyldes.</p> |
| <i>Koncentrationsrisiko</i> | | |
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — koncentrationsrisici | <p>Den absolutte værdi af de aktiver, som er følsomme over for koncentrationsrisici.</p> <p>For captive-selskaber, der er omfattet af koncerntilsyn, gælder det, at hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post den absolutte værdi af de aktiver, der er følsomme over for markeds koncentrationsrisici, efter hensyntagen til de forenklinger, der er tilladt for captive-selskaber.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Koncentrationsrisici | <p>Nettokapitalkravet for koncentrationsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne, sammenlagt for hver enkeltnavnseksponering.</p> <p>For captive-selskaber, der er omfattet af koncerntilsyn, gælder det, at hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for markeds koncentrationsrisici, beregnet ved hjælp af forenkede beregninger.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Koncentrationsrisici | Bruttokapitalkravet for koncentrationsrisici, sammenlagt for hver enkeltnavnseksponering, dvs. før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| Valutarisici | | |
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici | Summen for de forskellige valutaer af: <ul style="list-style-type: none"> — kapitalkravet (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for en stigning i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta — kapitalkravet (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for et fald i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Valutarisici | Summen for de forskellige valutaer af: <ul style="list-style-type: none"> — kapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for en stigning i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta — kapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for et fald i værdien af den udenlandske valuta i forhold til den lokale valuta. |
| R0610–R0620/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den samlede værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for valutarisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0610–R0620/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den samlede værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0610–R0620/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for valutarisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|--|
| R0610–R0620/ C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0610–R0620/ C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici — Stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Nettokapitalkravet for valutarisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. I R0610 indberettes kun de valutaer, for hvilke stødet ved stigning er størst, og i R0620 kun de valutaer, for hvilke stødet ved fald er størst. |
| R0610–R0620/ C0070 | Absolutte værdier efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — valutarisici — stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for valutarisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R0610–R0620/ C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Valutarisici — Stigning/fald i værdien af den udenlandske valuta | Bruttokapitalkravet for valutarisici, dvs. eksklusiv de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. I R0610 indberettes kun de valutaer, for hvilke stødet ved stigning er størst, og i R0620 kun de valutaer, for hvilke stødet ved fald er størst. |
| <i>Diversifikation inden for markedsrisikomodulet</i> | | |
| R0700/C0060 | Diversifikation inden for markedsrisikomodulet — netto | Diversifikationseffekten inden for markedsrisikomodulet som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodemoduler. Diversifikationen indberettes som en negativ værdi, når den mindsker kapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|--|
| R0700/C0080 | Diversifikation inden for markedsrisikomodulet — Brutto | Diversifikationseffekten inden for markedsrisikomodulet som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen indberettes som en negativ værdi, når den mindsker kapitalkravet. |
| <i>Samlet solvenskapitalkrav for markedsrisiko</i> | | |
| R0800/C0060 | Samlet markedsrisiko — nettosolvenskapitalkrav | Det samlede nettokapitalkrav for alle markedsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. |
| R0800/C0080 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for markedsrisiko | Det samlede bruttokapitalkrav for alle markedsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne beregnet ved brug af standardformlen. |
| <i>Valuta anvendt som reference til beregning af valutarisikoen</i> | | |
| R0810/C0090 | Valuta anvendt som reference til beregning af valutarisikoen | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der anvendes som reference til beregning af valutarisikoen |

S.26.02 — Solvenskapitalkrav — Modpartsrisici

Generelle bemærkninger

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.26.02 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.02 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i Solvens II-direktivet, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.

- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| Z0010 | Artikel 112 | <p>Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7</p> <p>2 — Regelmæssig indberetning</p> |
| Z0020 | Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje/resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer.</p> |
| R0010/C0010 | Forenklinger | <p>Angiv, hvorvidt et selskab har anvendt forenklinger ved beregningen af modpartsrisici. Valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>3 — Forenkling — puljeaftaler, med henblik på artikel 109</p> <p>4 — Forenkling af gruppering af enkeltnavnseksponeringer, med henblik på artikel 110</p> <p>5 — Forenkling af LGD for genforsikringsaftaler, med henblik på artikel 112a</p> <p>6 — Forenkling med henblik på type 1-eksponeringer, med henblik på artikel 112b</p> <p>7 — Forenkling for så vidt angår genforsikringsaftalers risikoreducerende virkning, med henblik på artikel 111</p> <p>9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 3 til 7 kan anvendes samtidigt.</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 4 eller 6, for type 1-eksponeringer, udfyldes kun R0100/C0080 med henblik på R0100.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| R0100/C0080 | Type 1-eksponeringer — bruttosolvenskapitalkrav | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorbende evne) for modpartsrisici hidrørende fra alle type 1-eksponeringer. Hvis R0010/C0010 = 4 eller 6, angiver denne post bruttosolvenskapitalkravet ved anvendelse af forenklinger. |
| R0110–R0200/ C0020 | Enkeltnavnseksponering | Angiv navnene på de ti største enkelte eksponeringer. |
| R0110–R0200/ C0030 | Kode for enkeltnavnseksponering | Angiv identifikationskoden ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke. |
| R0110–R0200/ C0040 | Kodetype for enkeltnavnseksponering | Angiv den kode, som anvendes under »Kode for enkeltnavnseksponering«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 9 — Ingen |
| R0110–R0200/ C0050 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for hver af ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| R0110–R0200/ C0060 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver af ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| R0300/C0080 | Type 2-eksponeringer — bruttosolvenskapitalkrav | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorbende evne) for modpartsrisici hidrørende fra type 2-eksponeringer som defineret med henblik på Solvens II. |
| R0310/C0050 | Type 2-eksponeringer — tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for type 2-modpartrisici hidrørende fra tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder. |
| R0320/C0050 | Type 2-eksponeringer — alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder — tab givet misligholdelse — tab givet misligholdelse | Tab givet misligholdelse for type 2-modpartrisici hidrørende fra alle andre type 2-eksponeringer end tilgodehavender fra mæglere, som har været forfaldne i over tre måneder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------------------------|---|---|
| R0330/C0080 | Diversifikation inden for modulet for modpartsrisici — bruttosolvenskapitalkrav | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved sammenlægningen af kapitalkrav for modpartsrisici hidrørende fra type 1- og type 2-eksponeringer. |
| R0400/C0070 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for modpartsrisici | Det samlede nettokapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for modpartsrisici. |
| R0400/C0080 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for modpartsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for modpartsrisici. |
| Nærmere oplysninger om realkreditlån | | |
| R0500/C0090 | Tab som følge af type 2-realkreditlån | Samlet tab som følge af realkreditlån, der er klassificeret som type 2-eksponeringer, i henhold til artikel 191, stk. 13, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0510/C0090 | Samlet tab som følge af realkreditlån | Samlet tab som følge af realkreditlån, i henhold til artikel 191, stk. 13, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

S.26.03 — Solvenskapitalkrav — Livsforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.26.03 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.03 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal beløbet for forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølge eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølge eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølge 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølge. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0010/C0010 | Anvendte forenklinger: dødelighedsrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af dødelighedsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100.</p> |
| R0020/C0010 | Forenklinger anvendt — levetidsrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0200.</p> |
| R0030/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0300.</p> |
| R0040/C0010 | Anvendte forenklinger — livsforsikringsoptionsrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn ved SCR-beregningen, har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Forenkling med henblik på artikel 95 2 — Forenkling med henblik på artikel 95a 9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt.</p> <p>Hvis R0040/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0400-R0420.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0050/C0010 | Anvendte forenklinger: omkostningsrisici for livsforsikringer | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af omkostningsrisici for livsforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0050/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0500.</p> |
| R0060/C0010 | Anvendte forenklinger: livsforsikringskatastroferisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af omkostningsrisici for katastroferisici ved livsforsikring. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger:</p> <p>2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0060/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0700.</p> |
| | <i>Livsforsikringsrisiko</i> | |
| R0100/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0100/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |
| R0100/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0100/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici | <p>Nettokapitalkravet for dødelighedsrisici efter stød (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne).</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for dødelighedsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger.</p> |
| R0100/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici | <p>Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici | <p>Bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici. (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne)</p> <p>Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger.</p> |
| R0200/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — levetidsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici.</p> <p>Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle.</p> |
| R0200/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — levetidsrisici | <p>Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for levetidsrisici.</p> <p>De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0200/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici | Nettokapitalkravet for levetidsrisici efter stød (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for levetidsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0200/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Levetidsrisici | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici | Bruttokapitalkravet for levetidsrisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for levetidsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0300/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0300/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. en stigning i invaliditets- og sygdomsintensiteten, som benyttes til beregning af forsikringsmæssige hensættelser for at afspejle invaliditets- og sygdomserfaringerne i de efterfølgende 12 måneder og for alle måneder efter de efterfølgende 12 måneder samt et fald i helbredelsesprocenterne for invaliditet og sygdom, som benyttes til beregning af forsikringsmæssige hensættelser for de efterfølgende 12 måneder og alle efterfølgende år. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0300/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0300/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0300/C0040) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici | Bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for optionsrisici, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for optionsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for optionsrisici. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for optionsrisici beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0040 | Oprindelige absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten beregnet ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0410/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten beregnet ved hjælp af forenkledte beregninger vedrørende optionsintensiteten. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0420/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten beregnet ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |
| R0420/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten) | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Bruttokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0040/C0010 = 1 og/eller 2, angiver denne post bruttokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten beregnet ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0430/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Nettokapitalkravet for masseoptionsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Optionsrisici — Masseoptionsrisici | Bruttokapitalkravet for masseoptionsrisici efter stød (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer: En stigning på 10 % i de udgifter, som tages i betragtning ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser, samt en stigning på ét procentpoint i den udgifts-inflationsrate (udtrykt i procent), som anvendes ved beregningen af forsikringsmæssige hensættelser). Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0500/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for livsforsikringer | Nettokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer inklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer beregnet ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0500/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for livsforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. beskrivelsen i definitionen i celle R0500/C0040) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for livsforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for livsforsikringer | Bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for livsforsikringer beregnet ved hjælp af forenkede beregninger. |
| R0600/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici. en procentvis stigning i annuitetsydelserne, der er anvendt i beregningen af forsikringsmæssige hensættelser Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, jf. definitionen i celle R0600/C0040) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici | Nettokapitalkravet for genoptagelsesrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0600/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et stød som foreskrevet ved standardformlen, jf. definitionen i celle R0600/C0040) af de forpligtelser (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for genoptagelsesrisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0700/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0700/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0700/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0700/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0700/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Livsforsikringskatastroferisici | Nettokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici beregnet ved hjælp af forenklede beregninger. |
| R0700/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — livsforsikringskatastroferisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for livsforsikringskatastroferisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0700/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Livsforsikringskatastroferisici | Bruttokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for livsforsikringskatastroferisici beregnet ved hjælp af forenklede beregninger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|---|---|
| R0800/C0060 | Diversifikation inden for modulet for livsforsikringsrisici — netto | Diversifikationseffekten inden for modulet for livsforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0800/C0080 | Diversifikation inden for modulet for livsforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for modulet for livsforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodelmoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0900/C0060 | Samlet nettosolvenskaptalkrav for livsforsikringsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for livsforsikringsrisici efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0900/C0080 | Samlet bruttosolvenskaptalkrav for livsforsikringsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav for livsforsikringsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| <i>Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici</i> | | |
| R1000/C0090 | Selskabsspecifikke parametre — Anvendte faktorer ved stød for genoptagelsesrisici | Stød for genoptagelsesrisici — koncernspecifikke parametre som beregnet af koncernen og godkendt af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |

S.26.04 — Solvenskapitalkrav — Sygeforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.26.04 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.04 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal beløbet for forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølge eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølge eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølge 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølge. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0010/C0010 | Forenklinger anvendt — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0100. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0020/C0010 | Forenklinger anvendt — levetidsrisici for sygeforsikringer | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af levetidsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0020/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0200.</p> |
| R0030/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes kun C0060/R0310 og C0080/R0310.</p> |
| R0040/C0010 | Anvendte forenklinger: invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0040/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0340.</p> |
| R0050/C0010 | Anvendte forenklinger: SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Forenkling med henblik på artikel 102 2 — Forenkling med henblik på artikel 102a 9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 1 og 2 kan anvendes samtidigt.</p> <p>Hvis R0050/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0400-R0420.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0051/C0010 | Forenklinger — Optionsrisici for NSLT-sygeforsikring | Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn ved SCR-beregningen, har anvendt forenklinger ved beregningen af optionsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 96a 9 — Forenklinger ikke anvendt |
| R0060/C0010 | Anvendte forenklinger: Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af omkostningsrisici for sygeforsikringer. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0060/C0010 = 1, udfyldes kun C0060 og C0080 med henblik på R0500. |
| | <i>SLT-sygeforsikringsrisici</i> | |
| R0100/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0100/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0100/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0100/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0100/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0100/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Dødelighedsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for dødelighedsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0010/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for dødelighedsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0200/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0200/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0200/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i dødelighedsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for levetidsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0200/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Levetidsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for levetidsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0020/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for levetidsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0300/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0300/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer. |
| R0310/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0310/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0320/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0320/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af en stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0320/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0320/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — stigning i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling i form af et fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Fald i udgifter til lægebehandling | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0330/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Fald i udgifter til lægebehandling | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0330/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Udgifter til lægebehandling — Stigning i udgifter til lægebehandling | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — udgifter til lægebehandling — fald i udgifter til lægebehandling. Hvis R0030/C0010 = 1, udfyldes denne række ikke. |
| R0340/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0340/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de aktiver, som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0340/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0340/C0070 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0340/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — Indkomstsikring | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring. Hvis R0040/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer — indkomstsikring beregnet ved hjælp af forenklinger. |
| R0400/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0400/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0410/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0410/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for stigning i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0410/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Nettokapitalkravet for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved hjælp af forenkede beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer. |
| R0410/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (en permanent stigning i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0410/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for stigning i optionsintensiteten | Bruttokapitalkravet (eksklusiv justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for en permanent stigning i optionsintensiteten. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for en permanent stigning i optionsintensiteten, beregnet ved hjælp af forenkede beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0420/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0420/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de aktiver, som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0420/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (dvs. et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i option | Nettokapitalkravet for risici for et permanent fald i optionsintensiteten efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer. |
| R0420/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Risici for fald i optionsintensiteten | Den absolutte værdi efter stød (et permanent fald i optionsintensiteten) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0420/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — risici for fald i option | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for risici for et permanent fald i optionsintensiteten. Hvis R0050/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for et permanent fald i optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet ved hjælp af forenklede beregninger vedrørende optionsintensiteten for SLT-sygeforsikringer. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0430/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for masseoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0430/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Nettokapitalkravet for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — masseoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0430/C0070 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for masseoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0430/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici | Bruttokapitalkrav (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for SLT-sygeforsikringsoptionsrisici — Masseoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0500/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — aktiver — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — forpligtelser — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0040 | Absolutte værdier efter stød — aktiver — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0500/C0050 | Absolutte værdier efter stød — forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post nettokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenkede beregninger. |
| R0500/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for omkostningsrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0500/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Omkostningsrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (eksklusive justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for omkostningsrisici for sygeforsikringer. Hvis R0060/C0010 = 1, angiver denne post bruttokapitalkravet for omkostningsrisici for sygeforsikringer beregnet ved hjælp af forenkede beregninger. |
| R0600/C0020 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0600/C0030 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0040 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0600/C0050 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0060 | Absolut værdi efter stød — Nettosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Nettokapitalkravet for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0600/C0070 | Absolut værdi efter stød — Forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Den absolutte værdi efter stød (dvs. som foreskrevet ved standardformlen, en %-stigning i det årlige beløb, som skal betales for annuiteter eksponeret mod genoptagelsesrisici) af de forpligtelser (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne), som er følsomme over for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0600/C0080 | Absolut værdi efter stød — Bruttosolvenskapitalkrav — Genoptagelsesrisici for sygeforsikringer | Bruttokapitalkravet (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for genoptagelsesrisici for sygeforsikringer. |
| R0700/C0060 | Diversifikation inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici — netto | Diversifikationseffekten inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af nettokapitalkravene (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodemoduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|--|---|
| R0700/C0080 | Diversifikation inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for modulet for SLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af bruttokapitalkravene (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for de enkelte risikodel-moduler. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0800/C0060 | Nettosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsrisici | Det samlede nettokapitalkrav for forsikringsrisici for SLT-sygeforsikringer, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R0800/C0080 | Bruttosolvenskapitalkrav — SLT-sygeforsikringsrisici | Det samlede bruttokapitalkrav for SLT-sygeforsikringsrisici før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| Nærmere oplysninger om genoptagelsesrisici | | |
| R0900/C0090 | Stød for genoptagelsesrisici — Selskabsspecifikke parametre | Stød for genoptagelsesrisici — koncernspecifikke parametre som beregnet af koncernen og godkendt af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | | |
| R1000–R1030/C0100 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre | Koncernens specifikke standardafvigelser for præmierisici for hver branche og dets proportionale genforsikring som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| R1000–R1030/C0110 | Standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre, brutto/netto | Angiv, om standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre er anvendt brutto eller netto. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Selskabsspecifikke parametre, brutto 2 — Selskabsspecifikke parametre, netto |
| R1000–R1030/C0120 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre — justeringsfaktor for ikke-proportional genforsikring | Den koncernspecifikke justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, som gør det muligt for koncerner at tage hensyn til den risikoreducerende virkning af særlig skadesexcedentgenforsikring pr. risiko — som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre, udfyldes denne celle ikke. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| R1000–R1030/ C0130 | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici — selskabsspecifikke parametre | Koncernens specifikke standardafvigelser for erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dets proportionale genforsikring som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| R1000–R1030/ C0140 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for præmierisici: Vprem | Mængdeangivelsen for præmierisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1000–R1030/ C0150 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for erstatningshensættelsesrisici: Vres | Mængdeangivelsen for erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1000–R1030/ C0160 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — Geografisk diversifikation | Den geografiske diversifikation, der skal anvendes til mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. Hvis faktoren for geografisk diversifikation ikke beregnes, fastsættes denne post til standardværdien 1. |
| R1000–R1030/ C0170 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — V | Mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 og 12, i delegeret forordning (EU) 2015/35, for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og dens proportionale genforsikring. |
| R1040/C0170 | Samlet mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici: — V | Den samlede mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko er lig med summen af mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko for alle brancher. |
| R1050/C0100 | Kombineret standardafvigelse | Den kombinerede standardafvigelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for alle segmenter. |
| R1100/C0180 | Solvenskapitalkrav — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring | Det samlede kapitalkrav for delmodulet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 og 12, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R1200/C0190 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R1200/C0200 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| R1200/C0210 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R1200/C0220 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser, som er følsomme over for optionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R1200/C0230 | Absolut værdi efter stød — Solvenskapitalkrav — Optionsrisici | Kapitalkravet for NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R1300/C0240 | Diversifikation inden for NSLT-sygeforsikringsrisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet for NSLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afsnit 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, som følge af sammenlægningen af kapitalkravene præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring og NSLT-sygeforsikringsoptionsrisici. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R1400/C0240 | Samlet solvenskapitalkrav for NSLT-sygeforsikring | Det samlede kapitalkrav for delmodulet for NSLT-sygeforsikringsrisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| | <i>Sygeforsikringskatastroferisici</i> | |
| R1500/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — delmodulet for masseulykkesrisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for masseulykkesrisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1500/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — delmodulet for masseulykkesrisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for masseulykkesrisici beregnet for justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R1510/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — ulykkeskoncentrationsrisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for ulykkeskoncentrationsrisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1510/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — ulykkeskoncentrationsrisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for ulykkeskoncentrationsrisici beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1520/C0250 | Nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — pandemirisici | Nettosolvenskapitalkrav for delmodulet for pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1520/C0260 | Bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici — pandemirisici | Bruttosolvenskapitalkrav for delmodulet for pandemirisici beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1530/C0250 | Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici — netto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for masseulykkesrisici, ulykkeskoncentrationsrisici og pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1530/C0260 | Diversifikation inden for sygeforsikringskatastroferisici — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for masseulykkesrisici, ulykkeskoncentrationsrisici og pandemirisici beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1540/C0250 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede nettokapitalkrav (efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne) for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici. |
| R1540/C0260 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede bruttokapitalkrav for delmodulet sygeforsikringskatastroferisici (før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne). |
| | <i>De samlede sygeforsikringsrisici</i> | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R1600/C0270 | Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet — netto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for delmodulet SLT-sygeforsikringsrisici, delmodulet NSLT-sygeforsikringsrisici og delmodulet sygeforsikringskatastroferisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet efter justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1600/C0280 | Diversifikation inden for sygeforsikringsrisikomodulet — brutto | Diversifikationseffekten inden for delmodulet sygeforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for delmodulet SLT-sygeforsikringsrisici, delmodulet NSLT-sygeforsikringsrisici og delmodulet sygeforsikringskatastroferisici, som omhandlet i afsnit I, kapitel V, afdeling 4, i delegeret forordning (EU) 2015/35, beregnet før justering for de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. |
| R1700/C0270 | Samlet nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici | Det samlede nettosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisikomodulet. |
| R1700/C0280 | Samlet bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici | Det samlede bruttosolvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisikomodulet. |

S.26.05 — Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.26.05 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.05 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Alle værdier skal indberettes med fradrag af genforsikring og andre risikoreduktionsteknikker.

Beløb før og efter stød indberettes sammen med værdierne for de aktiver og forpligtelser, som er følsomme over for det pågældende stød. For forpligtelserne skal vurderingen foretages med den største mulige detaljeringsgrad mellem kontrakt og homogen risikogruppe. Dette betyder, at hvis en kontrakt/homogen risikogruppe er følsom over for et stød, skal beløbet for forpligtelser knyttet til nævnte kontrakt/homogene risikogruppe indberettes som et beløb, som er følsomt over for det pågældende stød.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsporteføje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsporteføje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsporteføje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsporteføje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0010/C0010 | Forenklinger for captive-selskaber — præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | Angiv, hvorvidt et captive-selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, har anvendt forenklinger ved beregningen af præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Anvendte forenklinger: 2 — Forenklinger ikke anvendt Hvis R0010/C0010 = 1, udfyldes kun C0060, C0070 og C0090 udfyldes med henblik på R0100-R0230. |
| R0011/C0010 | Anvendte forenklinger — skadesforsikringsoptionsrisici | Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn ved SCR-beregningen, har anvendt forenklinger ved beregningen af skadesforsikringsrisici. Følgende valgmuligheder anvendes: 1 — Forenkling med henblik på artikel 90a 9 — Forenkling ikke anvendt |

| | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| | | |
| | <i>Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer</i> | |
| R0100–R0210/ C0020 | Standardafvigelse for præmierisici — standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre | Koncernens specifikke standardafvigelser for præmierisici for hvert segment som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| R0100–R0210/ C0030 | Standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre, brutto/netto | Angiv, om standardafvigelse for selskabsspecifikke parametre er anvendt brutto eller netto. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Selskabsspecifikke parametre, brutto 2 — Selskabsspecifikke parametre, netto |
| R0100–R0210/ C0040 | Standardafvigelse for præmierisici — selskabsspecifikke parametre — justeringsfaktor for ikke-proportional genforsikring | Den koncernspecifikke justeringsfaktor for ikkeproportional genforsikring for hvert segment, som gør det muligt for koncerner at tage hensyn til den risikoreducerende virkning af særlig skadesexcedentgenforsikring pr. risiko — som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| R0100–R0210/ C0050 | Standardafvigelse for erstatningshensættelsesrisici — selskabsspecifikke parametre | Koncernens specifikke standardafvigelser for erstatningshensættelsesrisici for hvert segment som beregnet af koncernen og godkendt eller fastsat af tilsynsmyndigheden. Denne post indberettes ikke, hvis der ikke anvendes koncernspecifikke parametre. |
| R0100–R0210/ C0060 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for præmierisici: Vprem | Mængdeangivelsen for præmierisici for hver branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0100–R0210/ C0070 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — mængdeangivelse for erstatningshensættelsesrisici: Vres | Mængdeangivelsen for erstatningshensættelsesrisici lig med det bedste skøn over hensættelserne til udestående krav for segmentet efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og fra SPV'er. |
| R0100–R0210/ C0080 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — Geografisk diversifikation — | Den geografiske diversifikation, der er anvendt til mængdeangivelsen for hvert segment. Hvis faktoren for geografisk diversifikation ikke beregnes, fastsættes denne post til standardværdien 1. |
| R0100–R0210/ C0090 | Mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici — V | Mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer for hvert segment Hvis R0010/C0010 = 1, angives under denne post kapitalkravet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer for et bestemt segment beregnet ved hjælp af forenklinger. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0220/C0090 | Samlet mængdeangivelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici | Den samlede mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko er lig med summen af mængdeangivelsen for præmie- og erstatningshensættelsesrisiko for alle segmenter. |
| R0230/C0020 | Kombineret standardafvigelse | Den kombinerede standardafvigelse for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for alle segmenter. |
| R0300/C0100 | Det samlede solvenskapitalkrav for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer | Det samlede solvenskapitalkrav for delmodulet for præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer. |
| | <i>Skadesforsikringsoptionsrisici</i> | |
| R0400/C0110 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Aktiver — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de aktiver, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0400/C0120 | Oprindelige absolutte værdier før stød — Forpligtelser — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi før stød af de forpligtelser, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0400/C0130 | Absolutte værdier efter stød — Aktiver — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de aktiver, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, skal ikke medtages i denne celle. |
| R0400/C0140 | Absolutte værdier efter stød — Forpligtelser — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Den absolutte værdi efter stød af de forpligtelser, som er følsomme over for skadesforsikringsoptionsrisici. De forsikringsmæssige hensættelser opgøres med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0400/C0150 | Solvenskapitalkrav — Skadesforsikringsrisici — Optionsrisici | Kapitalkravet for skadesforsikringsoptionsrisici. |
| | <i>Skadesforsikringskastroferisici</i> | |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| R0500/C0160 | Solvenskapitalkrav for skadesforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav for skadesforsikringskatastroferisici. |
| <i>De samlede skadesforsikringsrisici</i> | | |
| R0600/C0160 | Diversifikation inden for skadesforsikringsrisikomodulet | Diversifikationseffekten inden for delmodulet skadesforsikringsrisici som følge af sammenlægningen af kapitalkravene for præmie- og erstatningshensættelsesrisici, katastroferisici og optionsrisici. Diversifikationen skal indberettes som en negativ værdi, hvis den nedsætter kapitalkravet. |
| R0700/C0160 | Det samlede kapitalkrav for skadesforsikringsrisici | Solvenskapitalkravet for delmodulet for skadesforsikringsrisici. |

S.26.06 — Solvenskapitalkrav — Operationelle risici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR.26.06 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.06 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| Z0010 | Artikel 112 | <p>Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7</p> <p>2 — Regelmæssig indberetning</p> |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| R0100/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser (eksklusive risikomargin) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Forsikringsmæssige hensættelser for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked. I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0110/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for unit-linked livsforsikring (undtagen risikomargin) | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for livsforsikringsforpligtelser, hvor forsikringstagere bærer investeringsrisikoen I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0120/C0020 | Forsikringsmæssige bruttohensættelser for skadesforsikring (undtagen risikomargin) | Forsikringsmæssige hensættelser for skadesforsikringsforpligtelser. I denne forbindelse omfatter forsikringsmæssige hensættelser ikke risikomarginen og er uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler og SPV'er. |
| R0130/C0020 | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser. | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på forsikringsmæssige hensættelser. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0200/C0020 | Bruttopræmieindtægter (foregående 12 måneder) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0210/C0020 | Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne, uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0220/C0020 | Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de seneste 12 måneder for skadesforsikringsforpligtelser uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0230/C0020 | Bruttopræmieindtægter (12 måneder forud for de foregående 12 måneder) (bortset fra unit-linked eller indeksregulerede) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser undtagen unit-linked uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0240/C0020 | Bruttopræmieindtægter for unit-linked livsforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for livsforsikringsforpligtelser, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne, uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0250/C0020 | Bruttopræmieindtægter for skadesforsikring (12 måneder forud for de seneste 12 måneder) | Præmieindtægter i de 12 måneder forud for de seneste 12 måneder for skadesforsikringsforpligtelser uden fradrag af præmier cederet til genforsikring. |
| R0260/C0020 | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter | Kapitalkravet for operationelle risici baseret på præmieindtægter |
| R0300/C0020 | Kapitalkrav til dækning af operationelle risici før anvendelse af loft | Kapitalkravet for operationelle risici før anvendelse af loft. |
| R0310/C0020 | Loft baseret på det primære solvenskapitalkrav | Resultatet af den for loftet fastsatte procentdel anvendt på det primære solvenskapitalkrav. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0320/C0020 | Kapitalkrav til dækning af operationelle risici efter anvendelse af loft | Kapitalkravet for operationelle risici efter anvendelse af loft. |
| R0330/C0020 | Udgifter i forbindelse med unit linked virksomhed (seneste 12 måneder) | De udgifter, der er påløbet i de seneste 12 måneder med hensyn til livsforsikring, hvor investeringsrisikoen bæres af forsikringstagerne. |
| R0340/C0020 | Samlet kapitalkrav for operationelle risici | Kapitalkravet for operationelle risici |

S.26.07 — Solvenskapitalkrav — Forenklinger

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema SR 26.07 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.26.07 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|---|--|
| Z0010 | Artikel 112 | Angiver, om der er blevet anmodet om de indberettede tal i henhold til artikel 112, stk. 7, med henblik på et estimat over solvenskapitalkravet beregnet ved brug af standardformlen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Indberetning i henhold til artikel 112, stk. 7 2 — Regelmæssig indberetning |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsporteføje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsporteføje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsporteføje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsporteføje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. |
| Z0040 | Valuta for renterisici (captive-selskaber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for udstedelsen. Hver valuta skal indberettes i hver sin række |
| Markedsrisici (herunder captive-selskaber) | | |
| R0010/C0010–C0070 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — markedsværdi — efter kreditkvalitetstrin | Markedsværdien af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån for hvert kreditkvalitetstrin, hvor der foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0010/C0080 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Markedsværdi — Der foreligger ingen vurdering | Markedsværdien af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån, hvor der ikke foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0020/C0010–C0070 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Modifieret varighed — Efter kreditkvalitetstrin | Den modificerede varighed i år af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån for hvert kreditkvalitetstrin, hvor der foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |
| R0020/C0080 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — Modifieret varighed — Der foreligger ingen vurdering | Den modificerede varighed i år af aktiver, som er underlagt et kapitalkrav for kreditspændsrisici på obligationer og lån, hvor der ikke foreligger en kreditvurdering fra et udpeget ECAI. |

| | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------------------|---|--|
| R0030/C0090 | Kreditspændsrisici (obligationer og lån) — stigning i unit-linked og indeksregulerede forsikringsmæssige hensættelser | Stigningen i de forsikringsmæssige hensættelser med fradrag af risikomargin for de policer, hvor forsikringstagerne bærer investeringsrisikoen med indlejrede optioner og garantier, som ville følge af et umiddelbart fald i værdien af de aktiver, som er underlagt kapitalkravet for kreditspændsrisici på obligationer, ifølge den forenklede beregning. |
| <i>Renterisici (captiveselskaber)</i> | | |
| R0040/C0100 | Renterisici (captiveselskaber) — kapitalkrav — rentestigning — efter valuta | Kapitalkravet for risikoen for en stigning i rentekurven ifølge den forenklede beregning for captive-selskaber for hver indberettet valuta. |
| R0040/C0110 | Renterisici (captiveselskaber) — kapitalkrav — rentefald — efter valuta | Kapitalkravet for risikoen for et fald i rentekurven ifølge den forenklede beregning for captive-selskaber for hver indberettet valuta. |
| <i>Livsforsikringsrisiko</i> | | |
| R0100/C0120 | Dødelighedsrisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 91 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af dødelighedsrisici. |
| R0100/C0160 | Dødelighedsrisici — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0100/C0180 | Dødelighedsrisici — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved dødsfald, og som medtages i det bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0110/C0150 | Levetidsrisici — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af levetidsrisici. |
| R0110/C0160 | Levetidsrisici — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0110/C0190 | Levetidsrisici — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger til begunstigede, som medtages i det bedste skøn for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0120/C0120 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 93 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0120/C0130 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Risikosum t+1 | Risikosum som defineret i R0120/C0120 efter 12 måneder. |
| R0120/C0150 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |
| R0120/C0160 | Invaliditets- og sygdomsrisici — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+1 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0170 | Invaliditets- og sygdomsrisici — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+2 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de 12 måneder efter de efterfølgende 12 (t+2) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Modifieret varighed | Modifieret varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved invaliditet og sygdom, og som medtages i bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0120/C0200 | Invaliditets- og sygdomsrisici — Opsigelsesprocent | Den forventede opsigelsesprocent i de efterfølgende 12 måneder (t+1) for policer med en positiv risikosum. |
| R0130/C0140 | Optionsrisici (stigning) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle positive genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 95 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0130/C0160 | Optionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig optionsintensitet (t+1) | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med positive genkøbspåvirkninger. |
| R0130/C0190 | Optionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med positive genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0140/C0140 | Optionsrisici (fald) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle negative genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 95 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0140/C0160 | Optionsrisici (fald) — Gennemsnitlig optionsintensitet (t+1) | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med negative genkøbspåvirkninger. |
| R0140/C0190 | Optionsrisici (fald) — Gennemsnitlig afviklingsperiode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med negative genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0150/C0180 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i bedste skøn over livsforsikrings- og livsgenforsikringsforpligtelser. |
| R0150/C0210 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Betalinger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med livsforsikring og livsgenforsikring i de seneste 12 måneder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| R0150/C0220 | Omkostningsrisici for livsforsikringer — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter, der indgår i beregningen af det bedste skøn, til honorering af eksisterende livsforsikringsforpligtelser. |
| R0160/C0120 | Livsforsikringskatastroferisici — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 96 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| | <i>Sygeforsikringsrisiko</i> | |
| R0200/C0120 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 97 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af dødelighedsrisici for sygeforsikringer. |
| R0200/C0160 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0200/C0180 | Dødelighedsrisici for sygeforsikringer — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved dødsfald, og som medtages i det bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0210/C0150 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af levetidsrisici for sygeforsikringer. |
| R0210/C0160 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — gennemsnitlig dødelighedsintensitet t+1 | Gennemsnitlig dødelighedsintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægtet med forsikringssummen for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0210/C0180 | Levetidsrisici for sygeforsikringer — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af alle betalinger til begunstigede, som medtages i det bedste skøn for policer, hvor et fald i dødelighedsintensiteten fører til en stigning i de forsikringsmæssige hensættelser. |
| R0220/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Modifieret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i bedste skøn over forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling. |
| R0220/C0210 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Betalinger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling i de seneste 12 måneder. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| R0220/C0220 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (udgifter til lægebehandling) — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation for udgifter til lægebehandling, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter til lægebehandling, der indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser. |
| R0230/C0120 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Risikosum | Samlede positive risikosummer som defineret i artikel 100 i delegeret forordning (EU) 2015/35 for alle forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici (indkomstsikring). |
| R0230/C0130 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Risikosum t+1 | Risikosum som defineret i R0230/C0120 efter 12 måneder. |
| R0230/C0150 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Bedste skøn | Bedste skøn over forpligtelser med forbehold af invaliditets- og sygdomsrisici. |
| R0230/C0160 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+1 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de efterfølgende 12 (t+1) måneder vægтет med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0170 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet t+2 | Gennemsnitlig invaliditets- og sygdomsrisiciintensitet i de 12 måneder efter de efterfølgende 12 (t+2) måneder vægтет med forsikringssummen for policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0180 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Modifieret varighed | Modifieret varighed i år af alle betalinger, som forfalder ved invaliditet og sygdom, og som medtages i bedste skøn over policer med en positiv risikosum. |
| R0230/C0200 | Invaliditets- og sygdomsrisici for sygeforsikringer (indkomstsikring) — Opsigelsesprocent | Den forventede opsigelsesprocent i de efterfølgende 12 måneder for policer med en positiv risikosum. |
| R0240/C0140 | SLT-sygeforsikringsoptionsrisici (stigning) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle positive genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 102 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|----------------------|--|---|
| R0240/C0160 | SLT-sygeforsikrings- optionsrisici (stigning) — gennemsnitlig options- intensitet t+1 | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med positive genkøbspåvirkninger. |
| R0240/C0190 | SLT-sygeforsikrings- optionsrisici (stigning) — Gennemsnitlig afviklings- periode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med positive genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0250/C0140 | SLT-sygeforsikrings- optionsrisici (fald) — Genkøbspåvirkning | Summen af alle negative genkøbspåvirkninger som defineret i artikel 102 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| R0250/C0160 | SLT-sygeforsikrings- optionsrisici (fald) — gennemsnitlig options- intensitet t+1 | Gennemsnitlig optionsintensitet for policer med negative genkøbspåvirkninger. |
| R0250/C0190 | SLT-sygeforsikrings- optionsrisici (fald) — Gennemsnitlig afviklings- periode | Den gennemsnitlige periode i år, som policerne med negative genkøbspåvirkninger løber over. |
| R0260/C0180 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Modificeret varighed | Den modificerede varighed i år af de cash flow, der medtages i det bedste skøn over sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| R0260/C0210 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Beta- linger | Udgifter, der er betalt, i forbindelse med sygeforsikring og sygegenforsikring i de seneste 12 måneder. |
| R0260/C0220 | Omkostningsrisici for sygeforsikringer — Gennemsnitlig inflation | Den vægtede gennemsnitlige inflation, som indgår i beregningen af bedste skøn over de pågældende forpligtelser, hvor vægten er baseret på nutidsværdien af de udgifter, der indgår i beregningen af bedste skøn over eksisterende sygeforsikringsforpligtelser. |
| | <i>Markedsrisici — Markedskoncentra- tionsrisici</i> | |
| R0300/C0300 | Gældsporteføljeandel | Den gældsporteføljeandel, for hvilken der blev foretaget en forenklet SCR-beregning. Skal kun indberettes, hvis virksomheden er fritaget for indberetning af skema S.06.02 |
| NAT CAT-forenklinger | | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| R0400/C0330 | Storm — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — storm |
| R0410/C0330 | Hagl — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — hagl |
| R0420/C0330 | Jordskælv — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — jordskælv |
| R0430/C0330 | Oversvømmelse — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — oversvømmelse |
| R0440/C0330 | Jordskred — sum af eksponeringer omfattet af NAT CAT-forenklingerne | Medtag sum af eksponeringer omfattet af forenklinger — jordskred |

S.26.08 — Solvenskapitalkrav — for koncerner, der anvender partielle eller komplette interne modeller

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

Formålet med dette skema er at indsamle data på aggregeret niveau og vise diversificeringsfordelene mellem separate risikomoduler. Nogle poster stammer fra andre skemaer, men er anført nedenfor. Set ud fra et teknisk perspektiv er disse ikke kopieret, da de i alt væsentligt er de samme datapunkter. Således fremkommer de automatisk i et skema, når de udfyldes i et andet skema.

Partielle interne modeller:

Alle rækker for C0010 henviser til kapitalkravet for hver komponent uanset beregningsmetode (enten standardformel eller partiel intern model) efter justeringer for forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne, i det omfang de er indeholdt i beregningen af komponenterne.

For komponenterne forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne bør den tabsabsorberende evne anføres, når disse offentliggøres som særskilte komponenter (disse beløb bør offentliggøres som negative beløb).

For komponenter beregnet ved brug af standardformlen anføres i denne celle det teoretiske bruttosolvenskapitalkrav. For komponenter beregnet ved brug af den partielle interne model anføres her den værdi, som indregner fremtidige ledelseshandlinger indeholdt i beregningen, men ikke sådanne, som modelleres som en særskilt komponent.

Beløbene skal fuldt ud tage højde for diversifikationseffekter i henhold til artikel 304 i direktiv 2009/138/EF, hvis det er relevant.

I givet fald medregnes i disse felter ikke fordelingen af justeringen som følge af aggregeringen af de teoretiske solvenskapitalkrav på enhedsniveau for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer.

Skema SR.26.08 indberettes for ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del for hvert selskab under en intern model. For partielle interne modeller omfatter dette selskaber, hvor en partiel intern model anvendes på en ring-fenced fond og/eller matchtilpasningsportefølje i sin helhed, mens de øvrige ring-fenced fonde og/eller matchtilpasningsporteføljer anvender standardformlen. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Dette skema anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

For sådanne selskaber under en partiel intern model, hvor justering som følge af sammenlægningen af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer er relevant i tilfælde, hvor enheden har matchtilpasningsporteføljer eller ring-fenced fonde (undtagen sådanne, som falder ind under artikel 304 i direktiv 2009/138/EF) ved indberetning for selskabet som helhed, beregnes det teoretiske solvenskapitalkrav for risikomoduler samt de forsikringsmæssige hensættelsers og de udskudte skatters tabsabsorberende evne, som skal indberettes, som følger:

- Såfremt selskabet anvender den fulde justering som følge af aggregeringen af det teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer på enhedsniveau: De teoretiske solvenskapitalkrav beregnes, som om der ikke var ring-fenced fonde, og den tabsabsorberende evne beregnes som summen af den tabsabsorberende evne for alle ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer og resterende del.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikodelmoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for delmoduler.
- Såfremt selskabet anvender forenklingen på risikomoduler med henblik på at sammenlægge de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer for enheden, skal det teoretiske solvenskapitalkrav og den tabsabsorberende evne beregnes ved en direkte sammenlægning for moduler.

Justeringen som følge af sammenlægning for enheden af de teoretiske solvenskapitalkrav for ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer fordeles (C0060) til de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici), når den beregnes efter standardformlen. Det beløb, som skal fordeles til det enkelte risikomodul, beregnes som følger:

- Beregning af »q faktor« = $\frac{\text{justering}}{BSCR' - nSCR_{int}}$, hvor
 - *justering* = justering beregnet i overensstemmelse med en af de tre ovenfor omhandlede metoder
 - *BSCR'* = primært solvenskapitalkrav beregnet i overensstemmelse med oplysningerne i dette skema
 - *nSCR_{int}* = teoretisk solvenskapitalkrav for risici på immaterielle aktiver, jf. oplysningerne i dette skema
- Multiplikation af denne q-faktor med det teoretiske solvenskapitalkrav for de relevante risikomoduler (dvs. markedsrisici, modpartsrisici, livsforsikringsrisici, sygeforsikringsrisici og skadesforsikringsrisici).

Komplette interne modeller:

Skema SR 26.08 udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del for hvert selskab under en komplet intern model. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|---|---|
| <i>Aggregering</i> | | |
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje 2 — Resterende del |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af selskabet og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer. Hvis post Z0020 = 2, indberet »0«. |
| C0010/R0010 | Samlede værdi for fritstående risiko | Summen af de diversificerede kapitalkrav for hvert risikomodul. Diversifikation mellem risikomoduler er ikke omfattet. $S.26.09.04 \ C0020/R0020 + S.26.11.04 \ C0110/R0210 + S.26.12.01 \ C0070/R0220 + S.26.13.01 \ C0450/R2120 + S.26.13.01 \ C0150/R1210 + S.26.14.01 \ C0320/R0630 + S.26.15.01 \ C0220/R0070 +$ den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for koncerner, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0020 | Samlet beløb for diversifikation | Beløbet for diversifikationseffekter mellem risikomoduler Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0030 | Samlet beløb for diversificeret risiko før skat | Diversificeret kapitalkrav før skat. |
| C0010/R0040 | Samlet beløb for diversificeret risiko efter skat | Diversificeret kapitalkrav efter skat. |
| C0010/R0050 | Udskudte skatters tabsabsorberende evne | Justeringen for udskudte skatters tabsabsorberende evne Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0060 | Forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne | Justeringen for forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0010/R0070 | Samlet markeds- og kreditrisiko | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0010 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0080 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | S.26.08.01 C0010/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvor det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt markeds- og kreditrisici, ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0090 | Renterisici | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0060 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0100 | Rentevolatilitetsrisiko | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0110 | Inflationsrisiko | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0080 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0120 | Aktierisici | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0110 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0130 | Aktievolatilitetsrisiko | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0120 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0140 | Ejendomsrisici | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0130 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0150 | Valutarisici | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0140 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0160 | Kreditspændrisiko | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0180 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0170 | Kreditbegivenhedsrisici (migration og misligholdelse) | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0170 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0180 | Summen af kreditrisici (spænd, migration og misligholdelse) | Det samme som for S.26.09.04 C0020/R0150 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0190 | Risiko ved kreditbegivenhed ikke er dækket af markeds- og kreditrisiko | Solvenskapitalkravet tildelt de kreditbegivenhedsrisici, der ikke er omfattet af modulet for markeds- og kreditrisici. |
| C0010/R0200 | Risiko ved kreditbegivenhed er ikke dækket af markeds- og kreditrisiko — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0190 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvor det er relevant, med fradrag af diversifikationen, der er tildelt de kreditbegivenhedsrisici, som ikke er omfattet af modulet for markeds- og kreditrisici. |
| C0010/R0210 | Basisrisikoen ved finansielle instrumenter | Kapitalkrav tildelt basisrisikoen ved finansielle instrumenter (risiko for ufuldstændig afdækning, summen af prisforskellene mellem aktiv og sikringsinstrument). Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0760. |
| C0010/R0220 | Risici ved derivater | Kapitalkrav tildelt risici ved derivater (alle derivater anvendes ikke til sikringsformål). Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0770. |
| C0010/R0230 | Kapitalinteresser | Kapitalkrav tildelt kapitalinteresser. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0720. |
| C0010/R0240 | Likviditetsrisiko | Kapitalkrav tildelt likviditetsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0730. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0250 | Pensionsrisici | Kapitalkrav tildelt pensionsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0740. |
| C0010/R0260 | Koncentrationsrisiko | Kapitalkrav tildelt koncentrationsrisici. For selskaber, der anvender en komplet intern model, skal dette kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model og har anført dette i C0140/R0750. |
| C0010/R0270 | Samlet virksomhedsrisiko | Kapitalkrav tildelt virksomhedsrisici. Skal kun indberettes, hvis selskabet eksplicit foretager modelberegninger heraf i sin egen model. |
| C0010/R0280 | Samlet virksomhedsrisiko — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0240 med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt virksomhedsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0290 | Samlet forsikringsrisiko | S.26.08.04 C0010/R0310 + S.26.08.04 C0010/R0400 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0300 | Samlet forsikringsrisiko — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0290 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt forsikringsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0310 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici | Summen af S.26.08.04 C0010/R0360, R0370, R0380 + R0390 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0320 | De samlede nettoskadesforsikringsrisici — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0310 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt skadesforsikringsrisici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0330 | Risici ved naturkatastrofer, opgjort netto | S.26.13.04 C0430/R1690 + S.26.13.04 C0430/R1700 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0340 | Menneskeskabte risici, opgjort netto | S.26.13.04 C0430/R1710 + S.26.13.04 C0430/R1720 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0350 | Bruttoerstatningshensættelsesrisici | Det samme som for S.26.13.04 C0050/R0090 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0360 | Bruttopræmierisici | Det samme som for S.26.13.04 C0080/R0540 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0370 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici | Summen af S.26.08.04 C0010/R0420-R0480 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, eller summen af S.26.08.04 C0010/R0480-R0500 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0380 | De samlede livs- og sygeforsikringsrisici — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0400 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt risici ved livs- og sygeforsikring ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0390 | Dødelighedsrisici | S.26.14.04 C0070/R0010 + S.26.14.04 C0070/R0310 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0400 | Levetidsrisici | S.26.14.04 C0070/R0050 + S.26.14.04 C0070/R0360 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0410 | Invaliditets- og sygdomsrisici | S.26.14.04 C0070/R0110 + S.26.14.04 C0070/R0410 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0420 | Genoptagelse | S.26.14.04 C0070/R0160 + S.26.14.04 C0070/R0470 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0430 | Omkostningsrisici | S.26.14.04 C0070/R0240 + S.26.14.04 C0070/R0550 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0440 | Genoptagelsesrisici | S.26.14.04 C0070/R0260 + S.26.14.04 C0070/R0570 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, som anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0450 | Katastroferisici | Det samme som for S.26.14.04 C0070/R0250 + S.26.14.04 C0070/R0560 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant eller S.26.14.04 C0070/R0300 + S.26.14.04 C0070/R0600 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, afhængig af modellens udformning. |
| C0010/R0460 | Risici i forbindelse med tendenser | Det samme som for S.26.14.04 C0070/R0280 + S.26.14.04 C0070/R0580. |
| C0010/R0470 | Risici i forbindelse med niveau | Det samme som for S.26.14.04 C0070/R0290 + S.26.14.04 C0070/R0590. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0010/R0480 | Samlet operationel risiko | Det samme som for S.26.15.04 C0220/R0070 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant. |
| C0010/R0490 | Samlet operationel risiko — diversificeret | S.26.08.04 C0010/R0510 + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, med fradrag af den del af den samlede diversifikation, der er tildelt operationelle risici ved hjælp af selskabets algoritme. |
| C0010/R0500 | Andre risici | Kapitalkrav, der ikke er tildelt de her opførte kategorier + den del, der er beregnet ved hjælp af standardformlen for selskaber, der anvender en partiel intern model, hvis det er relevant, |
| C0050/R0010-R0500 | Fordeling af justeringer som følge af ring-fenced fonde og matchtilpasningsporteføljer | Hvis det er relevant, en del af den justering, som fordeles til hvert risikomodul efter den procedure, som er beskrevet under »Generelle bemærkninger«. Beløbet skal være positivt. |
| C0060/R0010-R0500 | Indregning af de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser og/eller udskudte skatter | Med henblik på at angive, hvorvidt de fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og/eller udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i beregningen, anvendes følgende udtømmende liste af valgmuligheder: 1 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 2 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 3 — Fremtidige ledelseshandlinger vedrørende forsikringsmæssige hensættelsers og udskudte skatters tabsabsorberende evne er indeholdt i komponenten 4 — Ingen indeholdt indregning af fremtidige ledelseshandlinger. |
| C0070/R0010-R0500 | Modelleret beløb | For hver komponent anføres i denne celle beløbet som beregnet ved brug af den partielle interne model. |
| C0080/R0510 | Memorandumpost: Beskrivelse af andre risici | Beskrivelse af, hvad der er omfattet af kapitalkravet i C0010/R0530. |

Modellerede specifikke risici — Det er muligt med flere tilfælde af »Modelleret« i kolonnerne i hver række, hvis C0140 er »Ikke modelleret«.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--------------------------------------|---|
| R0700-R0820/ C0140 | Modelleret udtrykkeligt i eget modul | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret er »Modelleret«, henvises der til tabellen i begyndelsen af LOG-filen, hvor man kan se, hvad der skal udfyldes. Hvis svaret er »Ikke modelleret«, udfyldes C0150 til C0190 for hver række, afhængigt af hvor risikoen er dækket. Hvis det ikke er dækket, skal alle koder i samme række være »Ikke modelleret«.</p> |
| R0700-R0770/ C0150 | Markeds- og kreditrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for markeds- og kreditrisici.</p> |
| R0700-R0770/ C0160 | Skadesforsikring | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for skadesforsikringsrisici.</p> |
| R0700-R0770/ C0170 | Livs- og sygeforsikringsrisici | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for livs- og sygeforsikringsrisici.</p> |
| R0700-R0770/ C0180 | Operationel risiko | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i modulet for operationelle risici.</p> |
| R0700-R0770/ C0190 | Andet | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Modelleret</p> <p>2 — Ikke modelleret</p> <p>Hvis svaret i C0140 er »Modelleret«, skal dette fastsættes til »Ikke modelleret«. Ellers skal det være »Modelleret«, hvis den risiko, der er angivet i de enkelte rækker, er omfattet i et andet risikomodulet, der ikke er omhandlet her.</p> |

S.26.09 — Intern model: Markeds- og kreditrisici — for finansielle instrumenter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

Kolonnen »Solvens II-værdi« (C0010) skal udfyldes under anvendelse af værdiansættelsesprincipperne i direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og tekniske standarder og retningslinjer vedrørende Solvens II.

Denne del af indberetningskravene omfatter markeds- og kreditrisici, der skyldes niveauet og volatiliteten i forbindelse med markedspriserne på finansielle instrumenter, hvilket har en indvirkning på værdien af selskabets eller koncernens aktiver og forpligtelser. Kreditrisikoen dække de sædvanlige tre aspekter »spænd«, »migration« og »misligholdelse«.

Tallene skal omfatte indvirkningen på aktiver og passiver, herunder indvirkningen på optioner og garantier og på fremtidige diskretionære ydelser for forsikringstagere (»de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne«).

Tallene skal ikke omfatte de udskudte skatters tabsabsorberende evne.

Skemaet består af tre hoveddele:

1. »Generelle oplysninger« om nogle få nøgleaspekter i tilgangen til modellering.
2. »Fritstående kapitalkrav for markeds- og kreditrisici og supplerende fordelingsdata«
3. »Data om følsomhed og eksponering«

S.26.09.04.01: Generelle oplysninger

Med hensyn til modeller om markeds- og kreditrisici kræves der her to oplysninger om fremgangsmåde og anvendelsesområde for modelleringen, da disse er vigtige for at kunne analysere data, nemlig: Hvorvidt modellen omfatter »aldringseffekter«, og hvorvidt ikke-finansielle instrumenter er omfattet i kreditrisikoen. Se yderligere oplysninger nedenfor.

S.26.09.04.02: Fritstående kapitalkrav for markeds- og kreditrisici og supplerende fordelingsdata

Baseret på kravene i artikel 228 i delegeret forordning (EU) 2015/35 tildeles der ved sandsynlighedsfordelingsprognosen, som ligger til grund for den interne model, sandsynligheder vedrørende ændringer enten i beløbet for forsikrings- og genforsikrings-selskabets basiskapitalgrundlag eller i andre monetære beløb, f.eks. overskud og tab, under forudsætning af at disse monetære beløb kan anvendes til at fastslå ændringerne i basiskapitalgrundlag. Det udtømmende sæt af indbyrdes udelukkende fremtidige begivenheder, som er omhandlet i artikel 13, stk. 38, i direktiv 2009/138/EF, indeholder et tilstrækkeligt antal begivenheder til at afspejle selskabets risikoprofil.

I skema S.26.09.04.02 anmodes brugere af interne modeller om at levere visse grundlæggende statistiske værdier fra fordelingen af kapitalgrundlagsindvirkninger, der har relation til »sandsynlighedsfordelingsprognosen«, når begivenheder begrænses til dem, der udelukkende forbindes med en vis type risiko (»fritstående risiko« eller »marginal risiko«) For eksempel ville den »marginale risiko« for renter især kunne dække ændringer i rentesatsens niveau, men bl.a. værdien af aktien ville typisk ikke blive ændret i simulationerne.

S.26.09.04.02 omfatter de typiske underrisici ved markeds- og kreditrisici og kræver tal i to undergrupper:

- I. »Solvenskapitalkrav«-lignende tal alt efter godtgørelsen for »langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger«, i lighed med QRT S.22 »Indvirkning af langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger«:

Disse tal bør associeres med 99,50 % VaR under den risikomåling, der blev anvendt til beregning af solvenskapitalkravet. Generelt set forventes man at anvende den modellerede »definition på solvenskapitalkrav« på basiskapitalgrundlaget uden restriktioner for anerkendelse og uden de udskudte skatters tabsabsorberende evne. Således kan det ønskede tal adskille sig fra 0,5 %-fraktilen i en selektion i forbindelse med de simulerede indvirkninger (med negativt tegn), der skyldes den statistiske estimator for 0,5-percentilen (f.eks. inklusive enhver interpolation og »udjævning«)

I forbindelse med disse indberetningskrav kaldes denne værdi for »den modellerede VaR« (mVaR) for 99,50 % af basiskapitalgrundlaget.

Denne VaR« for 99,50 % skal angives for de følgende variationer af »langsigtede garantier og overgangsforanstaltninger« (LGTM)

- mVaR 99,50 % inklusive alle de LTGM, som anvendes regelmæssigt
- mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser
- mVaR 99,50 % uden overgangsforanstaltninger vedrørende renter
- mVaR 99,50 % uden volatilitetsjustering (VA) og uden overgangsforanstaltninger
- mVaR 99,50 % uden matchtilpasning (MA) og uden alle de andre LTGM'er)

- II. Grundlæggende statistiske data fra »marginal fordeling«

Fra fordelingen for den pågældende marginale risiko angiv indvirkninger associeret med de følgende data. Værdierne skal tages direkte fra fordelingen, dvs. hvis mVaR er forskellig fra 99,50 %-fraktilen, angives tal uden at tage højde for karakteristika for den statistiske estimator:

- Middelværdi
- Standardafvigelse
- Indvirkninger svarende til mVaR for de identificerede fraktiler.

S.26.09.04.03: Data om følsomhed og eksponering

I skema S.26.09.04.03 anmodes der om data til støtte for analysen af resultater og risikoprofil, nemlig oplysninger om »følsomheder« vedrørende kapitalgrundlaget og »eksponering« for så vidt angår markeds- og kreditrisici for finansielle instrumenter.

I S.26.09.04.03 anmodes der for hver af de underrisici, der er omfattet af S.26.09.01.02, om data over eksponering i referencescenariet og i visse stressscenarier. Data over eksponering er Solvens II-værdien af de følgende poster, men kun for de angivelser under disse poster, som er underlagt den pågældende risiko.

- Aktiver
- Forpligtelser
- Aktiver minus forpligtelser
- Aktiver eksklusive unit-linked
- Forpligtelser eksklusive unit-linked
- Aktiver eksklusive unit-linked med fradrag af forpligtelser eksklusive unit-linked

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

Generelle oplysninger

| | | |
|-------------|--|--|
| C0010/R0020 | Type chokmodel for markedsrisici | <p>For markeds- og kreditrisiko følger de interne modeller vedrørende den etårige tids-horisont i Solvens II stort set to fremgangsmåder. Momentane chokmodeller eller forventninger set over et år, ved udgangen af hvilket f.eks. en obligation med en løbetid på to år ved forventningens begyndelse vil have en løbetid på 1 år. Selskabet anmodes om at besvare spørgsmålet vedrørende »markedsrisici«.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Momentan chokmodel</p> <p>2 — Projektionsmodel</p> |
| C0010/R0030 | Type chokmodel for kreditrisici | <p>For markeds- og kreditrisiko følger de interne modeller vedrørende den etårige tids-horisont i Solvens II stort set to fremgangsmåder. Momentane chokmodeller eller forventninger set over et år, ved udgangen af hvilket f.eks. en obligation med en løbetid på to år ved forventningens begyndelse vil have en løbetid på 1 år. Svaret bør gives for »kreditrisici«.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Momentan chokmodel</p> <p>2 — Projektionsmodel</p> |
| C0010/R0040 | Dækning af ikke-finansielle instrumenter | <p>Angiver, om kreditrisici for ikke-finansielle instrumenter er dækket i tabel 2 og 3 og i hvilket omfang. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Nej</p> <p>2 — Fuldstændigt</p> <p>3 — Delvist</p> <p>Valget går hovedsageligt på tilgangen i modelberegningen af risikoen vedrørende »kreditbegivenhed«, dvs. »migration« og »misligholdelse«. Særligt såkaldte »kreditportefølje-modeller« omfatter ikke bare instrumenter, men f.eks. også genforsikring, tilgodehaver og også ikkebalanceførte poster.</p> <p>De tilsvarende oplysninger er relevante for fortolkningen af række R12 til R17 i relation til kreditrisici i tabel 2 (»marginale risici«, S.26.09 R0150 til R0200) og i tabel 3 (»kombinerede risici«, S.26.09 R0010 til R0030).</p> |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: SOLVENSKAPITALKRAV OG FORDELINGSDATA

| | | |
|-------------------|-----------------------|--|
| C0020-C0060/R0040 | Summen af renterisici | Summen af de respektive værdier af C0020-C0060/R0060 og C0020-C0060/R0070. |
|-------------------|-----------------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0020-C0300/ R0050 | Summen af renterisiko, hvor Diversificeret renterisiko | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter renterisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i rentekurven eller i renternes volatilitet. Den omfatter ikke følsomheden over for nogen af aspekterne af kreditrisikoen.</p> <p>Her bør der kun tages højde for diversifikation mellem ændringer i rentekurven og ændringer i volatiliteten i renterne.</p> |
| C0020-C0300/ R0060 | Summen af renterisiko, hvor Renterisici | Denne risiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i rentekurven, men ikke ændringer i renternes volatilitet eller nogen af aspekterne af kreditrisikoen. |
| C0020-C0300/ R0070 | Summen af renterisiko, hvor Rentevolatilitetsrisiko | Denne risiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i renternes volatilitet, men ikke nogen af aspekterne af kreditrisikoen. |
| C0020-C0300/ R0080 | Inflationsrisiko | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter denne risiko følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i inflationen.</p> <p>Da inflation i visse interne modeller også er medregnet, f.eks. i forsikringsrisiko, bedes man sikre sig, at der ikke sker dobbelttælling.</p> |
| C0020-C0060/ R0090 | Summen af aktierisici | Summen af de respektive værdier af C0020-C0060/R0110 og C0020-C0060/R0120. |
| C0020-C0300/ R0100 | Summen af aktierisiko, hvor Aktierisici diversificeret | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter aktierisici følsomheden hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i aktiernes markedspriser.</p> <p>Her bør der tages højde for diversifikation mellem ændringer i omfanget af og ændringer i volatiliteten i markedspriser.</p> |
| C0020-C0300/ R0110 | Summen af aktierisiko, hvor Aktierisici | Aktierisici omfatter følsomheden hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet i aktiernes markedspriser. |
| C0020-C0300/ R0120 | Summen af aktierisiko, hvor Aktievolatilitetsrisiko | Aktievolatilitetsrisiko omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i volatiliteten i aktiernes markedspriser. |
| C0020-C0300/ R0130 | Ejendomsrisici | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter ejendomsrisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i ejendommenes markedspriser.</p> <p>Til forskel fra f.eks. aktierisiko kræves der ingen opdeling efter »niveau« og »volatilitet«.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0300/ R0140 | Valutarisici | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter valutarisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i niveauet eller volatiliteten i valutakurserne.</p> <p>Til forskel fra f.eks. aktierisiko kræves der ingen opdeling efter »niveau« og »volatilitet«.</p> |
| C0020-C0060/ R0150 | Summen af kreditrisici | <p>Summen af de respektive følgende værdier:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) (R0170) — Kreditspændrisici »Regeringer og centralbanker« (R0190) — Kreditspændrisici, øvrige (R0200) <p>Hvis opdelingen i »Regeringer og centralbanker« (R0190) og »øvrige« (R0200) ikke findes i modellen, anvendes der »Kreditspændrisici« (R0180) i stedet i summen.</p> |
| C0020-C0300/ R0160 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditrisici diversificeret | <p>Inden for markeds- og kreditrisici omfatter kreditrisici følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af aktiver som følge af ændringer i kreditspændrisici, kreditmigration eller kreditmisligholdelse.</p> <p>Her bør der tages højde for diversifikation mellem ændringer i kreditspændrisici, kreditmigration eller kreditmisligholdelse</p> <p>Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster.</p> |
| C0020-C0300/ R0170 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) | <p>Kreditbegivenhedsrisici omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af aktiver som følge af ændringer i kreditmigration eller kreditmisligholdelse.</p> <p>Der bør tages højde for diversifikation mellem kreditmigration og kreditmisligholdelse</p> <p>Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster.</p> |
| C0020-C0300/ R0180 | Summen af kreditrisici, hvor Kreditspændrisiko | <p>Kreditspændrisici omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter som følge af ændringer i spænd i forbindelse med den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes kreditmigration eller (delvis) misligholdelse.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|--|
| C0020-C0300/ R0190 | Kreditspændsrisici — kreditspændsrisiko »Regeringer og central- banker« | Kreditspændsrisici, »Regeringer og centralbanker«, omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter udstedt af regeringer og centralbanker som følge af ændringer i spænd i den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes migration eller (delvis) misligholdelse. Følgende liste indeholder de CIC-koder for aktivklasser, der tildelt regeringer eller centralbanker: 13, 14, 15, 16, 17 og 19 CIC-kode 13 og 14 er blevet anvendt til at angive obligationer, der udstedes af regionale regeringer og lokale myndigheder (RGLA). RGLA bør tildeles porteføljen for statslige papirer, hvis de er opført i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, og ellers til en ikke-finansiell erhvervsportefølje afhængig af deres kreditkvalitetstrin. |
| C0020-C0300/ R0200 | Kreditspændsrisiko, øvrige | Kreditspændsrisici, »øvrige«, omfatter følsomheden, hvad angår værdierne af aktiver, forpligtelser og finansielle instrumenter over for ændringer i værdierne af finansielle instrumenter, der ikke er udstedt af regeringer og centralbanker, som følge af ændringer i spænd i den risikofrie rentekurve, som ikke skyldes migration eller (delvis) misligholdelse. |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: Kombineret markeds- og kreditrisiko

| | | |
|-----------------------|--|---|
| C0020-C0060/ R0020 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Her anmodes om data for den kombinerede markeds- og kreditrisiko, dvs. risici som følge af niveauet af og volatiliteten i markedspriserne på aktiver, hvilket har en indvirkning på værdien af selskabets eller koncernens aktiver og forpligtelser. Kreditrisikoen dække de sædvanlige tre aspekter »spænd«, »migration« og »misligholdelse«. Der tildeles kreditrisiko alt efter anvendelsesområdet som defineret i den interne model, og den kan være begrænset til kun at omfatte finansielle instrumenter, eller den vil kunne omfatte ethvert aktiv og også ikkebalanceførte poster. |
| C0020-C0060/ R0010 | Summen af markeds- og kreditrisici (niveau 2- komponenter) | Summen af de respektive følgende værdier: — Diversificeret renterisici (R0050) — Inflationsrisiko (R0080) — Diversificeret aktierisici (R0100) — Ejendomsrisiko (R0130) — Valutarisiko (R0140) — Summen af kreditrisici (R0150) |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0020-C0060/ R0030 | Markeds- og kreditrisiko — diversificeret | Værdi svarende til forskellen mellem C0020-C0060/R0020 og C0020-C0060/R0010. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |

FRITSTÅENDE MARKEDS- OG KREDITRISIKO: Data om følsomhed og eksponering

| | | |
|-----------------------|---|--|
| C0310-C0360/ R0210 | Eksponering, der er følsom over for renter, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i Solvens II-balancen på den afgørende dag for eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt renterisici. |
| C0310-C0360/ R0220 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med -100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på -100 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0230 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med +100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på +100 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0240 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med -50 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på -50 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0250 | Rentesatser (parallelforskydning — alle løbetider) med +50 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en parallelforskydning på +50 basispoint på rentesatserne for alle løbetider. Bemærk venligst, at denne forskydning har indflydelse på alle løbetider og ikke kun dem før det såkaldte »last liquid point« (LLP). |
| C0310-C0360/ R0260 | Eksponering, der er følsom over for inflationsrater, — referencescenario/intet stød | Solvens II-værdien i Solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt inflationsrisici. |
| C0310-C0360/ R0270 | Inflationsrater -100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt inflationsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i inflationsraten på -100 %. Denne følsomhed bør anvendes i tråd med definitionen i de interne modeller og tildelingen af inflationsrisiko. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|--|---|
| C0310-C0360/ R0280 | Inflationsrater +100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt inflationsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i inflationsraten på +100 %. Denne følsomhed bør anvendes i tråd med definitionen i de interne modeller og tildelingen af inflationsrisiko. |
| C0310-C0360/ R0290 | Eksponering, der er følsom over for kredit- spænd, — referencesce- nario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt kreditspændrisici. |
| C0310-C0360/ R0300 | Spænd (ensartet forskyd- ning — alle løbetider og aktiver) -100 basispoint | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt kreditspændrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet forskydning i kreditspænd på -100 basispoint for alle løbetider og aktiver. |
| C0310-C0360/ R0310 | Spænd (ensartet forskyd- ning — alle løbetider og aktiver) + 100 basis- point | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt kreditspændrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet forskydning i kreditspænd på +100 basispoint for alle løbetider og aktiver. |
| C0310-C0360/ R0320 | Eksponering, der er følsom over for aktie- kursrisici, — reference- scenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt aktiekursrisici. |
| C0310-C0360/ R0330 | Aktier (ensartet forskyd- ning i værdier) -30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt aktiekursrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i værdien på -30 %. |
| C0310-C0360/ R0340 | Aktier (ensartet forskyd- ning i værdier) + 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt aktiekursrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i værdien på +30 %. |
| C0310-C0360/ R0350 | Eksponering, der er følsom over for ejen- domsrisici, — reference- scenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt ejendomsrisici. |
| C0310-C0360/ R0360 | Ejendom (ensartet forskydning i værdier) -30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt ejendomsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i værdien på -30 %. |
| C0310-C0360/ R0370 | Ejendom (ensartet forskydning i værdier) + 30 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt ejendomsrisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i værdien på +30 %. |
| C0310-C0360/ R0380 | Eksponering, der er følsom over for valutari- sici, — referencescena- rio/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt valutarisici. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0310-C0360/ R0390 | Valuta (ensartet forskydning i kurser) -10 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt valutarisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et ensartet fald i valutakursen på -10 %. |
| C0310-C0360/ R0400 | Valuta (ensartet forskydning i kurser) + 10 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt valutarisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en ensartet stigning i valutakursen på +10 %. |
| C0310-C0360/ R0410 | Eksponering, der er følsom over for rentevolatiliteten, — reference-scenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt rentevolatilitetsrisici. |
| C0310-C0360/ R0420 | Rentevolatilitetsrisiko, forringelse -25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i rentevolatiliteten på -25 %. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0420 eller R0430. |
| C0310-C0360/ R0430 | Rentevolatiliteten er faldet med -20 basispoint for normal volatilitet | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i rentevolatiliteten på -20 % for normal volatilitet. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0420 eller R0430. |
| C0310-C0360/ R0440 | Rentevolatilitetsrisiko, forøgelse + 25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i rentevolatiliteten på +25 %. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0440 eller R0450. |
| C0310-C0360/ R0450 | Rentevolatiliteten er steget med +20 basispoint for normal volatilitet | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i rentevolatiliteten på +20 % for normal volatilitet. Denne forskydning er en parallelskydning af hele volatilitetsoverfladen for volatiliteter af typen log-normal og normal. Den kan kun indberettes én af rækkerne R0440 eller R0450. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-----------------------|---|--|
| C0310-C0360/ R0460 | Eksponering, der er følsom over for aktievolatiliteten, — reference-scenario/intet stød | Solvens II-værdien i solvens II-balancen, opgjort pr. den aftalte dag i relation til eksponeringen som angivet ovenfor og underlagt aktievolatilitetsrisici. |
| C0310-C0360/ R0470 | Aktievolatiliteten er faldet med -25 %. | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med et fald i aktievolatiliteten på -25 %. |
| C0310-C0360/ R0480 | Aktievolatilitet, forøgelse +25 % | Solvens II-værdien af eksponeringen underlagt renterisikoen, jf. ovenstående, men i et scenario med en stigning i aktievolatiliteten på +25 %. |

S.26.10 — Intern model: Kreditbegivenhedsrisici — porteføljeoversigt

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

I henhold til følgende data anmodes der om seks forskellige aspekter af aktivporteføljen, som er underlagt risikoen for kreditmigration og kreditmisligholdelse set ud fra et porteføljeperspektiv. Alle typer eksponeringer er omfattet, særligt investeringer og genforsikring.

De fire hovedaspekter er:

- De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav
- De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi
- Opdelt efter aktivklasser
- Opdelt efter kreditkvalitetstrin (CQS)

For så vidt angår de ti største eksponeringer, kræves der to parametre for hver enkelt:

- »gruppe«, dvs. rangorden af eksponeringer for grupper af indbyrdes forbundne modparter
- »enkelt«, dvs. fritstående modparter

Eksempel: Et selskab A har den følgende kontraktuelle forbindelse med selskaber i en forsikringskoncern G. Og A er ikke en del af koncernen G: 1) A har en genforsikringskontrakt med selskab R i koncern G, 2) A besidder andele i den indbetalte kapital for R, og 3) A har et lån, der er udstedt af et livsforsikringselskab L i koncern G i selskabets aktivportefølje. Blokkene »gruppe« vil vise de tre kombinerede eksponeringer. Blokkene »enkeltstående« vil vise disse separat: 1) og 2) kombineret for modpart R og 3) for modpart L.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav (koncernniveau)

| | | |
|-------------------|--|---|
| C0010/R0030-R0120 | Navnet på koncernens eksponering | <p>Navnene på de ti største eksponeringer for modparter (på koncernniveau) med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav.</p> <p>Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici.</p> |
| C0020/R0010-R0130 | Markedsværdi | <p>Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0010-R0130 | Eksponering ved misligholdelse | <p>Beløbet for eksponeringer ved misligholdelse</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0010-R0130 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0020-R0120 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0060/R0020-R0120 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0010-R0130 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditrisikobidrag — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0010-R0130 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici — i R0030 til R0120 for de ti største eksponeringer — i R0020 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0130 for de resterende eksponeringer — i R0010 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav (enkelte eksponeringer)

| | | |
|-------------------|--------------------------------|--|
| C0090/R0160-R0250 | Eksponeringens navn | Navnene på de ti største eksponeringer blandt enkelte eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav. Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici. |
| C0020/R0140-R0260 | Markedsværdi | Markedsværdien i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0140-R0260 | Eksponering ved misligholdelse | Beløbet for eksponeringer ved misligholdelse: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0040/R0140-R0260 | Kreditrisikobidrag | Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici: — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0150-R0250 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0150-R0250 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0140-R0260 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0140-R0260 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici — i R0160 til R0250 for de ti største eksponeringer — i R0150 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0260 for de resterende eksponeringer — i R0140 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (koncernniveau)

| | | |
|-------------------|----------------------------------|--|
| C0010/R0290-R0380 | Navnet på koncernens eksponering | Navnene på de ti største eksponeringer for modparter (på koncernniveau) med hensyn til markedsværdi. |
|-------------------|----------------------------------|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0020/R0270-R0390 | Markedsværdi | <p>Markedsværdien i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0270-R0390 | Eksponering ved misligholdelse | <p>Beløbet for eksponeringer ved misligholdelse:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0270-R0390 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer |
| C0050/R0280-R0380 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0280-R0380 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %)</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0270-R0390 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | <p>Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0080/R0270-R0390 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | <p>Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0290 til R0380 for de ti største eksponeringer — i R0280 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0390 for de resterende eksponeringer — i R0270 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

De ti største eksponeringer med hensyn til markedsværdi (enkelte eksponeringer)

| | | |
|-------------------|--------------------------------|---|
| C0090/R0420-R0510 | Eksponeringens navn | <p>Navnene på de ti største eksponeringer blandt enkelte eksponeringer med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav.</p> <p>Indvirkningen på solvenskapitalkravet findes i kolonnen »Kreditrisikobidrag«, som vil være bidraget til solvenskapitalkravet for kreditrisici, dvs. inklusive diversifikation, og summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici.</p> |
| C0020/R0400-R0520 | Markedsværdi | <p>Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |
| C0030/R0400-R0520 | Eksponering ved misligholdelse | <p>Eksponering ved misligholdelse i indberetningsvaluta</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |
| C0040/R0400-R0520 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til kreditrisici, inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne, giver solvenskapitalkravet for kreditrisici:</p> <ul style="list-style-type: none"> — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0050/R0410-R0510 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0060/R0410-R0510 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer |
| C0070/R0400-R0520 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |
| C0080/R0400-R0520 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici — i R0420 til R0510 for de ti største eksponeringer — i R0410 for summen af disse ti største eksponeringer — i R0520 for de resterende eksponeringer — i R0400 for summen af alle eksponeringer (skal være 100 %) |

Opdelt efter aktivklasse

| | | |
|-------------------|--------------|---|
| C0020/R0530-R0640 | Markedsværdi | Markedsværdien i henhold til værdiansættelsen anvendt til solvensformål opdelt efter aktivklasse: — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige — I alt |
|-------------------|--------------|---|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|---|
| C0030/R0530-R0640 | Eksposering ved misligholdelse | <p>Eksposering ved misligholdelse opdelt efter aktivklasse:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige — I alt |
| C0040/R0530-R0640 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici (i indberetningsvalutaen), inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici.</p> <p>Bidrag opdelt efter aktivklasse:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige — I alt |
| C0050/R0530-R0630 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i aktivklasser:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige |
| C0060/R0530-R0630 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | <p>Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i aktivklasser:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige |
| C0070/R0530-R0640 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | <p>Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici opdelt efter aktivklasser</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige — I alt |
| C0080/R0530-R0640 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | <p>Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici opdelt efter aktivklasser</p> <ul style="list-style-type: none"> — Obligationer og lån — Dækkede obligationer — Statsobligationer — Realkreditlån — Aktivsikret — Andet — Kontanter — Tilgodehavender — Genforsikring og derivater — Kreditforsikring — Ikkebalanceførte og øvrige — I alt |

Opdelt efter kreditkvalitetstrin (CQS)

| | | |
|-------------------|--------------------------------|--|
| C0020/R0650-R0730 | Markedsværdi | <p>Markedsværdien i indberetningsvaluta i henhold til den værdiansættelse, der er anvendt til solvensformål opdelt efter kreditkvalitetstrin</p> <ul style="list-style-type: none"> — |
| C0030/R0650-R0730 | Eksponering ved misligholdelse | <ul style="list-style-type: none"> — Eksponering ved misligholdelse i indberetningsvaluta opdelt efter kreditkvalitetstrin. |
| C0040/R0650-R0730 | Kreditrisikobidrag | <p>Bidrag til solvenskapitalkravet for kreditrisici (i indberetningsvalutaen), inklusive diversifikation, dvs. summen af poster i denne kolonne giver solvenskapitalkravet for kreditrisici.</p> <ul style="list-style-type: none"> — |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--|--|
| C0050/R0650-R0720 | Gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig 1-årig sandsynlighed for misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i kreditkvalitetstrin. |
| C0060/R0650-R0720 | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) | Gennemsnitlig tab givet misligholdelse (i %) for aktiver opdelt i kreditkvalitetstrin. |
| C0070/R0650-R0730 | Markedsværdi (% af den samlede sum) | Andelen af markedsværdien (i %) i forhold til den samlede sum af markedsværdierne for eksponeringer for kreditbegivenhedsrisici opdelt efter kreditkvalitetstrin |
| C0080/R0650-R0730 | Kreditrisikobidrag (% af det samlede beløb) | Andelen af kreditrisikobidraget (i %) i forhold til de samlede solvenskapitalkrav for kreditrisici opdelt efter kreditkvalitetstrin. |
| C0100/R0740 | Kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) – 99,5 % | Det samlede beløb for kapitalkravet for kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«) for 99,5 %-fraktilen. |
| C0100/R0750 | Forventet tab — middelværdi | Den samlede middelværdi af sandsynlighedsfordelingen af de forventede tab for kreditbegivenhedsrisici (»migration og misligholdelse«). |

S.26.11 — Intern model: Kreditrisici — nærmere oplysninger om finansielle instrumenter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---|--|
| C0010-C0090/R0010 | Samlet eksponering ved misligholdelse | Eksponering ved misligholdelse for forskellige kreditkvalitetstrin. |
| C0010-C0090/R0020-R0080 | Specifikation af eksponering ved misligholdelse | Beløbet for eksponeringer ved misligholdelse opdelt efter forskellige aktivklasser og kreditkvalitetstrin. |

Sandsynlighed for misligholdelse — vægtet gennemsnit, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---|--|
| R0100 | Den samlede sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for forskellige kreditkvalitetstrin. |
| C0010-C0090/R0110-R0170 | Specifikation af sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse opdelt efter forskellige aktivklasser og kreditkvalitetstrin. |
| C0100/R0180 | Beskrivelse af andet | Resumé af indholdet i kategorien »Andet« omhandlet i række R0080 og R0170 med henblik på en vurdering af væsentlighed. |

Solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------|--|---|
| C0110/R0190 | Samlet ikkediversificeret kreditrisiko | Det samlede kapitalkrav for kreditrisici inden eventuelle diversifikationseffekter. |
| C0110/R0200 | Diversifikation: kreditrisiko | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved aggregering af kapitalkrav for kreditrisici. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0110/R0210 | Diversificeret risiko: kreditrisiko | Kapitalkrav i alt for kreditrisici. |

S.26.12 — Intern model: Kreditrisici — for ikke-finansielle instrumenter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

Type 1-eksponering med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------------|---------------------------------|---|
| C0010/R0020-R0110 | Enkeltnavnseksponering | Angiv navnene på de ti største enkelte eksponeringer. |
| C0020/R0020-R0110 | Kode for enkeltnavnseksponering | Angiv identifikationskoden ved hjælp af Legal Entity Identifier (LEI), hvis denne findes. Hvis den ikke findes, indberettes denne post ikke. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0030/R0010 | Summen af alle tab givet misligholdelse | Summen af tab givet misligholdelse for alle type 1-eksponeringer. |
| C0030/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — tab givet misligholdelse | Værdien af tab givet misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0030/R0120 | Type 1, aggregeret tab givet misligholdelse, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer | Tab givet misligholdelse for alle type 1-eksponeringer, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0040/R0010 | Summen af alle eksponeringer ved misligholdelse | Summen af eksponeringer ved misligholdelse for alle type 1-eksponeringer. |
| C0040/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — eksponering ved misligholdelse | Eksponeringsværdi ved misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0040/R0120 | Type 1, aggregeret eksponering ved misligholdelse, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer | Eksponeringsværdi ved misligholdelse for alle type 1-eksponeringer, eksklusiv de ti største enkeltnavnseksponeringer. |
| C0050/R0010 | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 1-eksponeringer | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 1-eksponeringer, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0050/R0020-R0110 | Type 1-eksponeringer — enkeltnavnseksponering X — sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver af de ti største enkeltnavnseksponeringer. |

Type 2-eksponering med hensyn til indvirkning på solvenskapitalkrav

| | | |
|-------------|---|---|
| C0030/R0130 | Summen af alle tab givet misligholdelse | Summen af tab givet misligholdelse for alle type 2-eksponeringer. |
|-------------|---|---|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|---|--|
| C0030/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — tab givet misligholdelse | <p>Tab givet misligholdelse for forskellige eksponeringer.</p> <p>For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0150.</p> <p>For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0160.</p> <p>For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0170.</p> |
| C0030/R0190 | For Type 2-eksponeringer aggregeres tab givet misligholdelse, eksklusive R0140—R0180. | Tab givet misligholdelse for alle type 2-eksponeringer, eksklusive R0140—R0180. |
| C0040/R0130 | Summen af alle eksponeringer ved misligholdelse | Summen af eksponeringer ved misligholdelse for alle type 2-eksponeringer. |
| C0040/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — Eksponering ved misligholdelse | <p>Eksponering ved misligholdelse for forskellige eksponeringer:</p> <p>For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0150.</p> <p>For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0160.</p> <p>For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0170.</p> |
| C0040/R0190 | For Type 2 aggregeres eksponering ved misligholdelse, eksklusive R0140—R0180. | Eksponering ved misligholdelse for alle type 2-eksponeringer, eksklusive R0140—R0180. |
| C0050/R0130 | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 2-eksponeringer | Vægtet gennemsnitlig sandsynlighed for misligholdelse for type 2-eksponeringer, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0050/R0140-R0180 | Type 2-eksponeringer — Sandsynlighed for misligholdelse | Sandsynligheden for misligholdelse for hver og en af R0140—R0180. For R0140 og R0150 skal det være den vægtede gennemsnitlige sandsynlighed for misligholdelse, hvor vægtningen er eksponering ved misligholdelse. |
| C0060/R0140-R0180 | Beskrivelse af eksponering | <p>Kort beskrivelse af type 2-eksponering.</p> <p>For R0160 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0150.</p> <p>For R0170 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0160.</p> <p>For R0180 medtages den anden vigtige eksponering, som er størst, eksklusive R0140—R0170.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---------------------------|--|--|
| <i>Solvenskapitalkrav</i> | | |
| C0070/R0200 | Den samlede ikkediversificerede modpartsrisiko | Det samlede kapitalkrav for modpartsrisici inden eventuelle diversifikationseffekter. |
| C0070/R0210 | Diversifikation: Modpartsrisici | Det beløb, som afspejler bruttodiversifikationseffekter, der er tilladt ved sammenlægningen af kapitalkrav for modpartsrisici hidrørende fra type 1- og type 2-eksponeringer. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0070/R0220 | Diversificeret risiko: Modpartsrisici | Det samlede kapitalkrav for modpartsrisici. |

S.26.13 — Intern model: Forsikringsrisici ved skades- og NSLT-sygeforsikring

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

Dette skema indeholder oplysninger om skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici i de følgende forskellige detaljeringsgrader med og uden fradrag af genforsikring ⁽¹⁾:

- Præmie- og erstatningshensættelsesrisici: Præmie- og erstatningshensættelsesrisici, inklusive Kat.:
- Katastroferisici (Kat.): Oplysninger om katastroferisici.
- Præmie- og erstatningshensættelsesrisici (eksklusive eksplicit Kat.): Præmie- og erstatningshensættelsesrisici, eksklusive eksplicit Kat.
- Præmierisici: Fordelingen af præmierisici bør være således, at dens middelværdi afspejler et forventet overskud eller tab, herunder præmiehensættelser i løbet af året. Resultater bør ekskludere Kat.
- Erstatningshensættelsesrisici: Fordelingen af erstatningshensættelsesrisici bør være således, at dens middelværdi er på ca. nul, da der ikke forventes overskud i henhold til et bedste skøn. Resultater bør ekskludere Kat.
- Inden for præmie- og erstatningshensættelsesrisici anmodes der om de to følgende opdelinger:
 - o Solvens II-brancher (S2LoB): Som defineret i bilag II til delegeret forordning, baseret på brancher (LoB'er) som defineret i bilag I.
 - o Brancher i henhold til interne modeller (IntLoB) Det forstås som det mest detaljerede niveau fra den interne models direkte output-data, for hvilket sandsynlighedsfordelingsfunktionen for tab og solvenskapitalkrav er til rådighed. Brancher i henhold til interne modeller (IntLoB) forventes at blive anvendt til intern indberetning og til forvaltningen af selskabets kapitalpositioner. Brancher i henhold til interne modeller ligger typisk tæt op ad et parameterniveau. De gør det muligt at forstå den interne models specifikke adfærd.

⁽¹⁾ Coassurance ved direkte forsikringsvirksomhed: For førende forsikringsselskaber antages hele andelen af virksomheden at skulle indberettes som direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, hvorved andelen, som deles med ikke-førende forsikringsvirksomheder, anses for at være cederet genforsikring.

Ved coassurance ved direkte forsikringsvirksomhed antages hele andelen af virksomheden for førende forsikringselskaber at skulle indberettes som direkte forsikringsvirksomhed, opgjort brutto, hvorved andelen som deles med ikke førende forsikringsvirksomheder skal anses for at være cederet genforsikring.

Generelt gælder følgende:

- Pengemæssige beløb, der offentliggøres i dette skema, medregnes ikke.
- Høje percentiler udgør negative resultater for selskabet, da den underliggende fordeling er en fordeling af tab (dvs. 99,5 anvendes til beregningen af solvenskapitalkravet).
- Generelt forventes det, at de ønskede tal findes i begge detaljeringsgrader (enten i henhold til interne modeller eller Solvens II-brancher), og at de konsekvent indberettes for hver af disse to detaljeringsgrader så vidt muligt (middelværditillæg osv.)
- Begrebet *diversificeret* anvendes i dette skema til at skelne mellem forskellige detaljeringsgrader (f.eks. er diversificeret erstatningshensættelsesrisici den samlede aggregerede erstatningshensættelsesrisiko sammenlignet med summen af de udiversificerede brancher i henhold til Solvens II).

Eftersom der er forskellige måder at modellere disse risici på anmodes selskaberne ikke om at ændre deres interne modeller med henblik på at følge kodernes struktur. Så hvis selskaber modellerer katastroferisici sammen med risici for præmier og/eller erstatningshensættelser, skal de ikke udfylde afsnittet med »Fordeling af tab fra katastroferisici«. Dertil kommer, at hvis selskaber opnår en specifik fordeling af præmie og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring og en separat fordeling for skadesforsikringsrisici, uden at aggregerer de to, så vil oplysningerne indgå i afsnittene »Samlet NSLT-sygeforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet NSLT-sygeforsikring med fradrag af genforsikring«, hhv. afsnittene »Samlet skadesforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet skadesforsikring med fradrag af genforsikring«. I modsat fald bør »Samlet skadesforsikring uden fradrag af genforsikring« — »Samlet skadesforsikring med fradrag af genforsikring« ikke indberettes.

Begivenheden OEP (Occurrence Exceedance Probability) er den sandsynlighed, at det dermed forbundne tabsniveau vil blive overskredet med enhver begivenhed i ethvert år. Den anvendes, når forsikringsprogrammet tegnes på grundlag af begivenheder, eller når tabet forbundet med en begivenhed er stort.

Begivenheden AEP (Aggregate Exceedance Probability) er den sandsynlighed, at det dermed forbundne tabsniveau vil blive overskredet med det aggregerede tab i et givet år, og anvendes, når forsikringsprogrammet tegner på aggregeret basis.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

Risikomodeldata

| | | |
|-------------|---|--|
| C0010/R0010 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for præmierisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Solvenskapitalkravet måles som afvigelsen fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0020.</p> <p>Nej — Solvenskapitalkravet måles som afvigelsen fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0020.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0020.</p> |
|-------------|---|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0010/R0020 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for præmierisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for præmierisici i henhold til den interne model (f.eks. af den »økonomiske« overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det parameter, der er defineret for solvenskapitalkravet i artikel 101 i Solvens II-direktivet, og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder den risikomåling, der er defineret i artikel 101 i Solvens II-direktivet, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model, jf. artikel 101 i Solvens II-direktivet«</p> |
| C0010/R0030 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for erstatningshensættelsesrisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> <p>Nej — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0040.</p> |
| C0010/R0040 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for erstatningshensættelsesrisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for erstatningshensættelsesrisici i henhold til den interne model (f.eks. af den økonomiske overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det standardparameter, der er anvendt for solvenskapitalkravet i Solvens II-direktivets afsnit 4, underafsnit 1 og 2, (med særlig fokus på artikel 101, 104, 105 og 108), og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, going concern osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder alle antagelser i afsnit 4, underafsnit 2, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model i tråd med definitionen af risikomåling ved standardformler«</p> |
| C0010/R0050 | Er risikomålingen af solvenskapitalkravet for katastroferisici centreret? | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>Ja — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra det forventede resultat (centreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> <p>Nej — Risikokapitalen omfatter en afvigelse fra nul (ikkecentreret risiko). Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> <p>Andet — Beskriv venligst under kode C0010/R0060.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0010/R0060 | Kort beskrivelse af den risikomåling af solvenskapitalkravet, der er anvendt for katastroferisici | <p>Beskriv metoden for beregning af risikomålingen af solvenskapitalkravet for katastroferisici i henhold til den interne model. (f.eks. af den økonomiske overskuds- og tabsfordeling).</p> <p>Anvend som referencepunkt det standardparameter, der er anvendt for solvenskapitalkravet i Solvens II-direktivets afsnit 4, underafsnit 1 og 2, (med særlig fokus på artikel 101, 104, 105 og 108), og gå igennem alle aspekter, hvor selskabets fremgangsmåde kan adskille sig (f.eks. afvigelser fra VaR 1/200, den 1-årige tidshorisont for risikoen, risiko som afvigelse fra det forventede resultat, going concern osv.).</p> <p>Hvis den godkendte risikomåling i henhold til den interne model opfylder alle antagelser i afsnit 4, underafsnit 2, bekræftes dette ved at indsætte »Risikomåling i henhold til intern model i tråd med definitionen af risikomåling ved standardformler«</p> |

Matchning af interne brancher

| | | |
|-------|-----------------------------------|---|
| C0020 | Intern branche | Navnet på intern branche anvendt i den interne model. Det skal være konsekvent i hele skemaet. |
| C0030 | Branche i henhold til Solvens II. | <p>Navnet på den branche inden for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, der indberettes. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| | | <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring.</p> <p>Det forventes, at forsikrings- og genforsikringselskaber angiver, i hvilken Solvens II-branche den interne branche indgår.</p> <p>Hvis en intern branche matcher to eller flere Solvens II-brancher, indberettes der i C0040 den tilsvarende andel (som en værdi mellem 0 og 1) af den interne branche for hver af de matchede Solvens II-brancher. Disse værdier skal tilsammen give 1 for hver intern branche, der matcher to eller flere Solvens II-brancher. Hvis der er en matchning på en til en, anføres der 1 i C0040.</p> |
| C0040 | Indikator for præmierisici | <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Tildelt præmierisici — Ikketildelt præmierisici |
| C0050 | Indikator for erstatningshensættelsesrisici | <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Tildelt erstatningshensættelsesrisici — Ikketildelt erstatningshensættelsesrisici |
| C0060 | Andel af intern branche tildelt Solvens II-branche | Andel af intern branche tildelt Solvens II-branche, udtrykt som decimaltal, (f.eks. ved 10 % anvendes der 0,1). |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|---|--------------------|--|
| <i>Risikomodelldata for bruttoerstatningshensættelsesrisici</i> | | |
| Z0010 | Solvens II-branche | <p>Navnet på den branche inden for skadesforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, der indberettes. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring 17 — Proportional anden motorgenforsikring 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring 21 — Proportional kredit- og kaufionsgenforsikring 22 — Proportional retshjælpsgenforsikring 23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance 24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab 25 — Ikkeproportional sygegenforsikring 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. 28 — Ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| Z0020 | Risikotype | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko 2 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret 3 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko 4 — Erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0070 | Diversificeret erstatningshensættelsesrisici, udtrykkeligt eksklusiv katastroferisici | Aggregeret erstatningshensættelsesrisici med/uden fradrag af genforsikring efter anvendelse af diversifikationseffekter i forbindelse med forskellige risici. Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil. |
| C0080 | Solvens II-brancher | Erstatningshensættelsesrisici med/uden genforsikring for hver enkelt Solvens II-brancher. Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil. |
| C0090 | Intern brancher | Erstatningshensættelsesrisici med/uden genforsikring for hver enkelt intern brancher. Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate felter, der er beskrevet i afsnittet »Fordeling af tab fra katastroferisici« i denne LOG-fil. |
| R0070 | Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | Bedste skøn over erstatningshensættelser (uden fradrag af genforsikring), som endnu ikke er afregnet. Det omfatter alle endnu ikke afregnede erstatningshensættelser, indberettet og ikke-indberettet. Baseret på Solvens II-direktivets artikel 77 svarer det bedste skøn til det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige cash flow under hensyntagen til den tidsmæssige værdi af penge (forventet nutidsværdi af de fremtidige cash flow) under anvendelse af den relevante risikofrie rentekurve. |
| R0080 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshensættelsesrisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, vedrørende direkte og accepteret forsikringsvirksomhed. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles erstatningshensættelsesrisici. |
| R0090 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringskoncerner har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern brancher, Solvens II-brancher og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto. Denne celle repræsenterer den fritstående risiko for den respektive opdeling med anvendelse af den godkendte risikomåling i henhold til den interne model. |
| R0100 | Simuleret (output) middelværdi | Middelværdien for fordelingsprognosen vedrørende overskud og tab i henhold til den godkendte model, dvs. relevant for beregningen af det officielle solvenskapitalkrav. Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på udiskonteret basis). |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--------------------------------------|--|
| R0110 | Simuleret (output) standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen af de fremtidige cash flow (kombineret kvotelignende — combined ratio styled) i tilknytning til forsikringsbegivenheder over en tidshorizont på et år pr. referencedatoen for indberetningen. Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0120-R0330 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | <p>Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen af de fremtidige cash flow i tilknytning til forsikringsbegivenheder over en tidshorizont på et år pr. referencedatoen for indberetningen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis).</p> <p>Hvis definitionen af risikomåling er i tråd med definitionen af risikomåling i artikel 101 i Solvens II-direktivet, vil 99,5-percentilen være forskellig fra den simulerede (output) middelværdi fra solvenskapitalkravet.</p> |

Risikomodeldata for nettoerstatningshensættelsesrisici

| | | |
|-------------|---|--|
| R0340 | Erstatningshensættelser for udestående krav — diskonteret | Bedste skøn over erstatningshensættelser (med fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler), som endnu ikke er afregnet. Det omfatter alle endnu ikke afregnede erstatningshensættelser, indberettet og ikke-indberettet. Baseret på Solvens II-direktivets artikel 77 svarer det bedste skøn til det sandsynlighedsvægtede gennemsnit af fremtidige cash flow under hensyntagen til den tidsmæssige værdi af penge (forventet nutidsværdi af de fremtidige cash flow) under anvendelse af den relevante risikofrie rentekurve. |
| R0350 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles erstatningshensættelsesrisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles erstatningshensættelsesrisici. |
| R0360 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringskoncerner har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
| R0370 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0380 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0390-R0600 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Risikomodeldata for bruttopræmierisici

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| Z0020 | Risikotype | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Præmierisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko</p> <p>2 — Præmierisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret</p> <p>3 — Præmierisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko</p> <p>4 — Præmierisici for skadesforsikringer</p> |
| C0100 | Diversificeret erstatningshensættelsesrisici, eksklusive eksplicit katastroferisiko | <p>Aggregeret præmierisici med/uden fradrag af genforsikring efter anvendelse af diversifikationseffekter blandt forskellige risici.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil.</p> |
| C0110 | Solvens II-branche | <p>Præmierisici med/uden genforsikring for hver enkelt Solvens II-branche.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil.</p> |
| C0120 | Intern branche | <p>Præmierisici med/uden genforsikring for hver enkelt intern branche.</p> <p>Det vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmierisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil.</p> |
| R0610 | Tegnede bruttopræmier | Tegnede bruttopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldne til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. |
| R0620 | Bruttopræmieindtægter | summen af tegnede bruttopræmier minus ændringen i bruttopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. |
| R0630 | De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning | De tegnede bruttopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning, gennem bindende aftaler enten underskrevet før eller efter referencedatoen. |
| R0640 | Hensættelser for tegnede bruttopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | Hensættelser for tegnede præmier uden fradrag af genforsikring. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0650 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er og finite reinsurance, vedrørende direkte og accepteret forsikringsvirksomhed. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0660 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringskoncerner har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto. |
| R0670 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for tabsandelen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0680 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0690-R0900 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Risikomodelldata for nettopræmierisici

| | | |
|-------|--|--|
| R0910 | Tegnede præmier, opgjort netto | Tegnede nettopræmier omfatter alle beløb, der i regnskabsåret er forfaldet til betaling, for forsikringsaftaler i tilknytning til direkte forsikringsvirksomhed, uanset om disse beløb helt eller delvis vedrører et senere regnskabsår. |
| R0920 | Indtjent nettopræmie | Summen af tegnede nettopræmier minus ændringen i nettopræmiehensættelser for direkte forsikringsvirksomhed. |
| R0930 | De tegnede nettopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen | De tegnede nettopræmier, der er planlagt i de 12 måneder, der følger referencedatoen for indberetning, gennem aftaler om tilsagn enten underskrevet før eller efter referencedatoen. |
| R0940 | Hensættelser for tegnede nettopræmier på referencedatoen (kun hvis præmiehensættelser er allokeret til præmierisici) | Hensættelser for tegnede præmier med fradrag af genforsikring. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| R0950 | Præmiehensættelser — diskonteret (kun hvis præmiehensættelsen tildeles præmierisici) | Den diskonterede sum af fremtidige cash flows, som omfatter præmiehensættelser uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Denne celle skal udfyldes, hvis præmiehensættelsen på referencedatoen for indberetning tildeles præmierisici. |
| R0960 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringskoncerner har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
| R0970 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0980 | Simuleret standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R0990-R1200 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Samlet skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici uden fradrag af genforsikring

| | | |
|-------|---------------------------|---|
| Z0020 | Risikotype | <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret, med implicit katastroferisiko</p> <p>2 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring og for NSLT-sygeforsikring, aggregeret</p> <p>3 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikring, med implicit katastroferisiko</p> <p>4 — Præmierisici og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer</p> <p>5 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, aggregeret separat med implicit katastroferisiko</p> <p>6 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikring, aggregeret separat.</p> |
| C0130 | Ikkediversificerede i alt | Det samlede beløb for skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici inden anvendelsen af diversifikationseffekter over for forskellige skadesforsikringsrisici. Beløbet vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmie- erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--------------------------------------|--|
| C0140 | Diversifikation | Forskellen mellem den samlede ikkediversificerede fritstående forsikringsrisiko ved skades- og NSLT-sygeforsikring og den samlede diversificerede skadesforsikringsrisiko. Denne værdi er diversifikationseffekten og skal indberettes som en negativ værdi. |
| C0150 | Diversificeret | Det samlede beløb for skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici efter anvendelsen af diversifikationseffekter over for forskellige skadesforsikringsrisici. Beløbet vil omfatte katastroferisici, hvis det modelleres sammen med præmie- erstatningshensættelsesrisici, i modsat fald indberettes katastroferisici ved anvendelse af de separate koder, der er beskrevet i afsnittet »FORDELING AF TAB FRA KATASTROFERISICI« i denne LOG-fil. |
| R1210 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringsselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort brutto. |
| R1220 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1230 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1240-R1450 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (uden fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Samlet skadesforsikrings- og NSLT-sygeforsikringsrisici med fradrag af genforsikring

| | | |
|-------------|--------------------------------------|---|
| R1460 | Solvenskapitalkrav | De midler, som forsikrings- eller genforsikringsselskaber har brug for, for at kunne håndtere deres risici. Solvenskapitalkravet skal anføres for hver enkelt intern branche, Solvens II-branche og for det aggregerede niveau baseret på data om genforsikring, opgjort netto. |
| R1470 | Simuleret (output) middelværdi | Dette er middelværdien for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1480 | Simuleret (output) standardafvigelse | Dette er standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen Output er opnået baseret på simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |
| R1490-R1700 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes af selskabet, at det angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen i forbindelse med sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

Fordeling af tab fra katastroferisici

| | | |
|-------|--|--|
| C0020 | Klasser, der er påvirket af katastrofebegivenheden | Liste over alle klasser, der er påvirket af katastrofebegivenheden for den relevante risiko. |
|-------|--|--|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0160 | Katastrofal | Navnet på naturkatastrofe eller menneskeskabte risici for hver modelleret region. Anfør venligst betegnelsen for regionen og risikoen. Anfør ikke generiske betegnelser som region1 eller risiko1. Det henstilles at anvende engelske betegnelser for risici og regioner. |
| C0170 | Den kommercielt tilgængelige anvendte salgsmodel (såfremt den findes) | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0180 | Den kommercielt tilgængelige anvendte salgsmodels navn og udgave (såfremt den findes) | Hvis en kommercielt tilgængelig salgsmodel anvendes i den interne model for risikoen, bør dette felt indeholde modellens betegnelse og den udgave af modellen, som simulationerne er baseret på. |
| C0190 | Forklarende oplysninger (hvis tabet ved AEP ikke er til rådighed) | Anfør korte og præcise oplysninger om model og årsager, hvis feltet »AEP-tab« ikke er til rådighed. Efter aftale med den ansvarlige tilsynsførende kan dette felt også anvendes til oplysninger om modelleringsmetoder i andre tilfælde. |
| C0200 | Forsikringssum i alt | Forsikrings- og genforsikrings-selskabet forventes at indberette den samlede forsikringssum for direkte forsikringsvirksomhed opdelt efter risiko og region. |
| C0210 | Eksponeringsbeløb | Det eksponeringsbeløb, der er anvendt af det selskab, som der sammen med den respektive tilsynsførende blev truffet aftale om. Det anvendte parameter kan være forskelligt for risici og regioner |
| C0220 | Eksponeringsparameter | Kort beskrivelse af det eksponeringsparameter, der er anvendt i foregående kolonne (C6). |

Fordeling af tab fra katastroferisici — Virksomhed i alt (ejendom og øvrig virksomhed)

| | | |
|-----------------------|---|--|
| Z0010 | Intern branche | Navnet på den interne branche, der er anvendt af selskabet. |
| C0230-C0400/ R1710 | Simuleret middelværdi fra modellen for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | <p>Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen svarende til den enkelte risiko og aggregering af risici. Output er opnået baseret på simulation. Middelværdien indberettes i henhold til følgende opdeling:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Middelværdi for OEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto — Middelværdi for AEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto — Middelværdi for det årlige tab for al genforsikringsvirksomhed, opgjort brutto — Middelværdi for OEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto — Middelværdi for AEP for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto — Middelværdi for det årlige tab for al genforsikringsvirksomhed, opgjort netto <p>»Det årlige tab« er udtrykkeligt ikke »Det gennemsnitlige årlige tab« (AAL), men det tab, der fastsættes i henhold til statistisk måling, dvs. middelværdi, standardafvigelse eller percentil. AAL svarer til middelværdien for det årlige tab.</p> |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|--|--|
| C0230-C0400/R1720 | Simuleret standardafvigelse for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen svarende til den enkelte risiko og aggregering af risici. Output er opnået baseret på simulation. Standardafvigelsen bør indberettes med den samme opdeling som den simulerede middelværdi. |
| C0230-C0400/R1730-R1810 | Simulerede percentiler for den samlede virksomhed (ejendom og øvrig virksomhed) | Percentiler fra sandsynlighedsfordelingen, som er opnået ved simulation, for hver risiko og aggregering af risici. De indberettede percentiler er 0,75, 0,9, 0,96, 0,98, 0,99, 0,995, 0,996, 0,998 og 0,999. Standardafvigelsen bør indberettes med den samme opdeling som den simulerede middelværdi. |

Data om præmier og forsikringssum

| | | |
|-------------------|--|---|
| C0410/R1820-R1950 | Årlig bruttopræmie — Direkte forsikringsvirksomhed | Opdeling af de årlige tegnede bruttopræmier for direkte forsikringsvirksomhed efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Afrika, Det nordøstlige USA, Det sydøstlige USA, Midtvesten i USA, Det vestlige USA, Nordamerika (undtagen USA), Caribien & Mellemamerika, Sydamerika, Australien, Japan, Asien (undtagen Japan) og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. Definitionen af disse geografiske regioner findes i bilag III i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35. Når en af de ovenfor nævnte geografiske regioner omfatter flere af de definerede regioner i den delegerede forordning, bør alle lande i undergrupperne tages i betragtning for denne region. Den eneste undtagelse her er Japan som er adskilt fra resten af Asien. |
| C0420/R1820-R1950 | Den samlede forsikringssum — Direkte forsikring | Opdeling af den samlede forsikringssum for direkte forsikringsvirksomhed efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Afrika, Det nordøstlige USA, Det sydøstlige USA, Midtvesten i USA, Det vestlige USA, Nordamerika (undtagen USA), Caribien & Mellemamerika, Sydamerika, Australien, Japan, Asien (undtagen Japan) og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. Definitionen af disse geografiske regioner findes i bilag III i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/35. Når en af de ovenfor nævnte geografiske regioner omfatter flere af de definerede regioner i den delegerede forordning, bør alle lande i undergrupperne tages i betragtning for denne region. Den eneste undtagelse her er Japan som er adskilt fra resten af Asien. |
| C0410/R1960-R1990 | Årlig bruttopræmie — Genforsikring | Forsikrings- og genforsikringsselskaber forventes at opdele deres årlige tegnede bruttopræmie for genforsikring efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Nordamerika og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. |
| C0420/R1960-R1990 | Den samlede forsikringssum — Genforsikring | Forsikrings- og genforsikringsselskaber forventes at opdele deres årlige tegnede bruttopræmie for genforsikring efter geografisk region. De geografiske regioner, der skal anvendes, er Europa, Nordamerika og Resten af verden. Ikkeallokerede præmier anbringes i gruppen for ikkeallokerede. |

OPDELING AF PRÆMIEINDTÆGTER

| | | |
|-------------|--------------------|---|
| C0430/R2000 | Direkte forsikring | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers direkte forsikringsvirksomhed |
|-------------|--------------------|---|

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---------------|--|
| C0430/R2010 | Genforsikring | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers genforsikringsvirksomhed |
| C0430/R2020 | Retrocession | Præmieindtægter (beregnete allokerede bruttopræmieindtægter for de kommende 12 måneder som anvendt i modellen) for forsikrings- og genforsikringsselskabers retrocession. |

ANDRE SIGNIFIKANTE RISICI

| | | |
|-------------|-----------------------------|---|
| C0440/R2030 | Andre signifikante risici | Forsikrings- og genforsikringsselskaber angiver her, hvis deres virksomhed indeholder andre signifikante risici, der ikke er omfattet af ovennævnte naturkatastrofer eller menneskeskabte risici, med et »ja«, i modsat fald angives »nej«. |
| C0440/R2040 | Beskrivelse af andre risici | Hvis der i ovennævnte celle er svaret »ja«, angiver forsikrings- og genforsikringsselskaber her en beskrivelse af denne eller disse andre signifikante risici. |

AGGREGERING AF SOLVENSKAPITALKRAVET FOR KATASTROFER — Indberettet med fradrag af genforsikring

| | | |
|-------------|---|--|
| C0450/R2050 | Samlet ikkediversificeret risiko ved naturkatastrofer | Summen af separate solvenskapitalkrav for alle naturkatastroferisici. |
| C0450/R2060 | Diversifikation mellem naturkatastroferisici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem naturkatastroferisici. Beregnet som solvenskapitalkrav for naturkatastroferisici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle naturkatastroferisici. |
| C0450/R2070 | Den samlede ikkediversificerede menneskeskabte risiko | Summen af solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici. |
| C0450/R2080 | Diversificering mellem menneskeskabte risici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem menneskeskabte risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for menneskeskabte risici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici. |
| C0450/R2090 | Andre skadesforsikringskatastroferisici | Solvenskapitalkrav for andre skadesforsikringskatastroferisici |
| C0450/R2100 | Diversifikation af andre skadesforsikringskatastroferisici | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem andre risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for andre risici — Summen af separate solvenskapitalkrav for alle andre risici. |
| C0450/R2110 | Skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret i alt | Effekten på solvenskapitalkravet af diversificering mellem naturkatastroferisici, menneskeskabte risici og andre risici. Beregnet som solvenskapitalkrav for katastroferisici — solvenskapitalkrav for naturkatastroferisici — solvenskapitalkrav for alle menneskeskabte risici — solvenskapitalkrav for alle andre risici. |
| C0450/R2120 | De samlede skadesforsikringskatastroferisici — diversificeret | Solvenskapitalkrav for katastroferisici. |

S.26.14 — Intern model: Livs- og sygeforsikringsrisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

I dette skema indberettes resultaterne af interne modeller for livsforsikring og SLT-sygeforsikring. Hvis forsikringsvirksomheder også integrerer NSLT-sygeforsikringsrisici i modelstrukturen for livsforsikring og SLT-sygeforsikring, skal resultaterne fra modellen for NSLT-sygeforsikring også indberettes i dette skema.

Afhængig af strukturen i modelberegningen af livsforsikrings- og SLT-sygeforsikringsrisici skal én af de to blokke for levetidsrisici og dødelighedsrisici anvendes. Hvis strukturen i den interne model er af en sådan art, at levetidsrisici og dødelighedsrisici modelberegnes sammen, indberettes der for disse risici kun R0270, hvor disse risici er kombineret.

Generelt set gælder, at hvis celler ikke på fornuftig vis kan indberettes, skal der vælges en alternativ løsning. Hvis f.eks. et selskab ikke kan adskille modelberegningen af tendenser, niveau eller volatilitet i et undermodul, angives disse oplysninger på det tilsvarende aggregerede niveau.

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|------|------|------------|
|------|------|------------|

VALGMULIGHED 1 — LIVSFORSIKRINGSRISICI

| | | |
|---|---|--|
| C0010/R0010, R0060, R0250, R0270 C0030-C0040/ R0110 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«). |
| C0050/R0010, R0060, R0110, R0250, R0270 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier med fradrag af genforsikring indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0010, R0060, R0110, R0250, R0270 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0010- R0270 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. De følgende forklaringer gælder for C0070 — C0260: For de aggregerede risici skal solvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende underrisici indberettes. For optionsrisici gælder følgende: — »Optionsrisici« omfatter udøvelsen af aftalebestemte optioner i bred forstand. — Risiko for en stigning i optionsintensiteten (R0170) og et fald i optionsintensiteten (R0180) er andre optionsrisici end masseoptionsrisici, hvor R0170 (R0180) omfatter den del af virksomheden, der fører til et tab, hvis optionsintensiteten stiger (falder), som defineret i den interne model. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|---|
| | | <p>— Masseoptionsrisici (R0190) er risikoen for akkumulering eller katastroferisici i forbindelse med optionsrisici, som defineret i den interne model.</p> <p>— »Opdeling af optionsrisici (som ikke er masseoptionsrisici)« omfatter ikke-masseoptionsrisici, hvis en opdeling i stigning/fald ikke er til rådighed, og kan opdeles i tre brede kategorier: »fuldstændigt genkøb«, dvs. kontraktens ophør, »delvis genkøb« og »andet«, hvilket er en udnyttelse af de aftalebestemte optioner eller »forsikringstagers adfærd«.</p> |
| C0080/R0010-R0270 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto |
| C0090/R0010-R0270 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0010-R0270 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

VALGMULIGHED 2 — LIVSFORSIKRINGSRISICI

Skal udfyldes, hvis den interne model kun har en opdeling mellem tendensrisiko og niveaurisiko. I så fald erstatter følgende skema (S.26.14.01.02) ovennævnte skema (S.26.14.01.01).

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0010/R0300 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn for katastroferisici indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. |
| C0050/R0300 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto for katastroferisici indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0300 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb for katastroferisici indberettes for de produkter i livsforsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0280-R0300 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. For de aggregerede risici skal nettosolvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes. |
| C0080/R0280-R0300 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|--|
| C0090/R0280-R0300 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0280-R0300 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

VALGMULIGHED 1 — SUNDHEDSRISICI

| | | |
|--|---|---|
| Z0010 | Type sygeforsikringsrisici modelberegnet i livs- og sygeforsikringsrisici? | I den udtømmende liste findes der tre muligheder: SLT, NSLT og SLT+NSLT |
| C0010/R0310, R0360, R0560 C0030-C0040/R0410-R0460 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«). |
| C0050/R0310, R0360, R0410-R0460, R0560 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0310, R0360, R0410-R0460, R0560 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0310-R0570 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. De følgende forklaringer gælder for C0070 — C0260: For de aggregerede risici skal solvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes. For optionsrisici gælder følgende: — »Optionsrisici« omfatter udøvelsen af aftalebestemte optioner i bred forstand. — Risiko for en stigning i optionsintensiteten (R0480) og et fald i optionsintensiteten (R0490) er andre optionsrisici end masseoptionsrisici, hvor R0480 (R0490) omfatter den del af virksomheden, der fører til et tab, hvis optionsintensiteten stiger (falder), som defineret i den interne model. — Masseoptionsrisici (R0500) er risikoen for akkumulering eller katastroferisici i forbindelse med optionsrisici, som defineret i den interne model. »Opdeling af optionsrisici (som ikke er masseoptionsrisici)« omfatter ikke-masseoptionsrisici, hvis en opdeling i stigning/fald ikke er til rådighed, og kan opdeles i tre brede kategorier: »fuldstændigt genkøb«, dvs. kontraktens ophør, »delvis genkøb« og »andet«, hvilket er en udnyttelse af de aftalebestemte optioner eller »forsikringstagers adfærd«. |

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------|---------------------------------|--|
| C0080/R0310-R0570 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto |
| C0090/R0310-R0570 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0310-R0570 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

VALGMULIGHED 2 — SUNDHEDSRISICI

Skal udfyldes, hvis den interne model kun har en opdeling mellem tendensrisiko og niveaurisiko. I så fald erstatter følgende skema (S.26.14.01.05) ovennævnte skema (S.26.14.01.03).

| | | |
|-------------------------|---|---|
| C0010/R0600 | Bedste skøn over forpligtelser opgjort netto og forsikringsmæssige hensættelser under et. | Det bedste skøn indberettes med fradrag af genforsikring og henviser til de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. De forsikringsmæssige hensættelser beregnet som en helhed bør også indgå. Opdelingen i aggregeret risici for invaliditet og sygdom henviser til udbetalte annuiteter (»APO«) eller ikke udbetalte (»ANPO«). |
| C0050/R0600 | Tegnede præmier, opgjort netto | De samlede tegnede præmier, opgjort netto indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0060/R0600 | Forsikringssum | Summen af det samlede forsikringsbeløb indberettes for de sundhedsprodukter i forsikringsporteføljen, som er følsomme over for den relevante risikokategori. |
| C0070/R0580-R0600 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav for den relevante risikokategori, med fradrag af genforsikring. For de aggregerede risici skal nettosolvenskapitalkravet efter aggregering af de underliggende undermoduler indberettes. |
| C0080/R0580-R0600 | Middelværdi | Middelværdien for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkrav opgjort netto |
| C0090/R0580-R0600 | Standardafvigelse | Standardafvigelsen for sandsynlighedsfordelingen for solvenskapitalkravet opgjort netto |
| C0100-C0310/R0580-R0600 | Percentiler fra 0,001 til 0,999 | Det forventes, at forsikrings- og genforsikringsselskaberne angiver værdierne for de percentiler, der er påkrævet i tabellen over sandsynlighedsfordelingen, og som er opnået ved simulation (med fradrag af genforsikring og på diskonteret basis). |

SOLVENSKAPITALKRAV

| KODE | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|--|
| C0320/R0610 | Samlet ikkediversificeret risiko: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | Summen af alle (under)solvenskapitalkrav. Med hensyn til optionsrisici vælges den sum, der er hensigtsmæssig for opdelingen på det mest detaljerede niveau. Eksempler: 1) Hvis optionsrisici stiger, og optionsrisici falder, og masseoptionsrisici er til rådighed, skal disse lægges sammen. Uanset om opdelingen af optionsrisici også er til rådighed. 2) Hvis masseoptionsrisici og opdeling af optionsrisici er til rådighed, herunder også opdeling af optionsrisici på underniveau, lægges summen af masseoptionsrisici og opdeling af optionsrisici sammen. Hvis der kun findes underniveauer af opdeling af optionsrisici, vælges disse. |
| C0320/R0620 | Diversifikation: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | Diversificeringen mellem underrisici. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0320/R0630 | Diversificeret risiko: Livsforsikring Sygeforsikring, Livs- og sygeforsikring | De aggregerede solvenskapitalkrav for livsforsikring eller sygeforsikring efter aggregering af alle underrisici. |

S.26.15 — Intern model: Operationelle risici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema indberettes på grundlag af tilgængeligheden af data i henhold til den interne modelstruktur og risikoprofil efter så vidt muligt at have gjort en rimelig indsats. De data, som skal indberettes, aftales mellem de nationale tilsynsmyndigheder og koncernerne.

Hvert selskab kan anvende sin egen klassifikation af operationelle risici.

Kolonne C0020-C0060 indeholder oplysninger om de scenarier, som selskabet har defineret. Hvis der findes klassificeringer på flere niveauer, angives der som minimum data for de to højeste niveauer af operationelle risici (definer L1 som det højeste og L2, hvis det findes, som det umiddelbart følgende). Alle de oplysninger, der skal angives, er knyttet til den 1-årige prognosticerede sandsynlighedsfordeling af tab.

For en begivenhedstype, der er defineret som en niveau 1-begivenhed (L1), bør alle numeriske oplysninger (solvenskapitalkrav, fraktiler) henvise til den risikoaggregering, der er sket på dette niveau. Hver kategori, som er klassificeret som en niveau 2-begivenhed (L2), kan stamme fra en aggregering af lavere niveauer af fordelingerne af tab.

| Intern klassificering af scenarier [fritekst] | Unik ID [tal] | Unik ID for moderselskabet. [tal] | |
|--|------------------|--------------------------------------|--|
| L2 A | 201 | 101 | Bemærk, at ID for det relevante niveau ikke vurderes for L1-niveauer, da niveauet for det øverste moderselskab i sig selv er den operationelle risiko. |
| L2 B | 202 | 101 | |
| L2 C | 203 | 101 | |
| L2 D | 204 | 102 | |
| L2 E | 205 | 102 | |
| L1 A | 101 | | |
| L1 B | 102 | | |

Operationelle risici

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|---|
| C0010/R0010 | Er Basel L1 klassifikationen anvendt? | Angiv, om de syv højniveaukategorier (L1), der er anført i Basel II, er anvendt. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0010/R0020 | Er Basel L1- og L2-klassifikationen anvendt? | Angiv, om Baselkategorierne niveau 1 og 2 og deres hierarki (hvilke L2 der indgår i den enkelte L1) er specificeret i Basel II [Bilag 7]. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0020 | Navnet på scenariet | Dette skema skal udfyldes af alle koncerner, også i tilfælde, hvor selskaber svarer »Nej« til C0010/R0010 og/eller C0010/R0020, med angivelse af navnene på de interne scenarier, der er anvendt i den interne model til beregninger af den operationelle risiko. |
| C0030 | Unik ID | Det er et unikt ID for det interne scenario. Det bør være konsistent over tid. Dette er et numerisk felt. |
| C0040 | Unik ID for moderselskabet. | Det er et unikt ID for det interne scenario hos det umiddelbare moderselskab. Det bør være konsistent over tid. Dette er et numerisk felt. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|--|
| C0050 | Indpasning i Basel L1-klassification | <p>For udfyldelse af selskaber, som svarer »ja« i C0010/R0010, eller for hvilke der findes en indpasning i Basel L1. Feltet bør være tomt, hvis scenariet er højere end L2 i klassifikationen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Intern svig 2) Ekstern svig 3) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen 4) Skader på fysiske aktiver 5) Forretningsforstyrrelser og systemfejl 6) Kunder, produkter og forretningspraksis 7) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning |
| C0060 | Indpasning i Basel L2-klassification | <p>For udfyldelse af selskaber, som svarer »ja« i C0010/R0020, eller for hvilke der findes en indpasning i Basel L2. Feltet bør være tomt, hvis scenariet er højere end L2 i klassifikationen.</p> <p>Begivenheden »Andet« kan anvendes, hvis risikoen kan klassificeres i en Basel-kategori L1, men der findes ingen L2.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Intern svig — Uautoriseret aktivitet 2) Intern svig — Tyveri og svig 3) Intern svig — Andet 4) Ekstern svig — Tyveri og svig 5) Ekstern svig — Systemsikkerhed 6) Ekstern svig — Andet 7) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Relationer mellem ansatte 8) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Sikkert miljø 9) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Diversitet og diskriminering 10) Ansættelsesvilkår og sikkerhed på arbejdspladsen — Andet 11) Skader på fysiske aktiver — Katastrofer og andre begivenheder 12) Skader på fysiske aktiver — Andet |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------|---|
| | | <p>13) Forretningsforstyrrelser og systemfejl — Systemrelateret</p> <p>14) Forretningsforstyrrelser og systemfejl — Andet</p> <p>15) Kunder, produkter og forretningspraksis — Egnethed, offentliggørelse og forvaltning</p> <p>16) Kunder, produkter og forretningspraksis — Ukorrekt forretnings- eller markedspraksis</p> <p>17) Kunder, produkter og forretningspraksis — Produktfejl</p> <p>18) Kunder, produkter og forretningspraksis — Udvælgelse, sponsorering og eksponeering</p> <p>19) Kunder, produkter og forretningspraksis — Rådgivningsaktiviteter</p> <p>20) Kunder, produkter og forretningspraksis — Andet</p> <p>21) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Registrering, afvikling og vedligeholdelse af transaktioner</p> <p>22) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Overvågning og indberetning</p> <p>23) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Tilførsel af kunder og dokumentation</p> <p>24) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Kundeforvaltning</p> <p>25) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Handelspartner</p> <p>26) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Sælgere og leverandører</p> <p>27) Ordreaufvikling, levering og procesforvaltning — Andet</p> |
| C0070 | Sandsynlighedsfordeling | <p>Angiv sandsynlighedsfordelingen. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Poisson-lognormal 2. Lognormal 3. Poisson-Pareto 4. Empirisk 5. Pareto 6. Andet, anfør nærmere 7. Opnået ved aggregering af lavere niveauer <p>Post 1 til 6 skal anvendes, hvis sandsynlighedsfordelingen kvantificeres, post 7 anvendes, hvis sandsynlighedsfordelingen opnås ved aggregering af lavere niveauer.</p> |
| C0080 | Solvenskapitalkrav | Solvenskapitalkrav med fradrag af risikoreducerende aftaler pr. scenario. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|--|--|
| C0090-C0210 | percentiler | Percentiler for fordelingen af tab (tab svarer til den højre del) med fradrag af de risikoreducerede aftaler pr. scenario. |
| C0220/R0030 | Det samlede niveau 2, ikkediversificeret | Summen af fritstående kapitalkravsbidrag for operationelle risici i henhold til niveau 2-klassifikationen. Et lavere aggregeringsniveau bør allerede overvejes. |
| C0220/R0040 | Summen af diversifikation blandt poster på niveau 2 | Forskellen mellem summen af solvenskapitalkrav for ikkediversificerede delrisici (leaf risks) og C0220/R0030. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. F.eks. hvis det lavere niveau er L3 (dem med kvantificeret sandsynlighedsfordeling) indsæt forskellen mellem summen i L3 og summen i L2 (fritstående). |
| C0220/R0050 | Det samlede niveau 1, ikkediversificeret | Summen af fritstående kapitalkravsbidrag for operationelle risici i henhold til niveau 1-klassifikationen. Et lavere aggregeringsniveau bør allerede overvejes. |
| C0220/R0060 | Operationelle risici — diversifikation mellem poster på niveau 1 | Forskellen mellem C0220/R0050 og C0220/R0070. Denne værdi bør indberettes som en negativ værdi. |
| C0220/R0070 | Operationel risiko — diversificeret | Kapitalkrav for diversificeret operationel risiko med fradrag af risikoreducerende aftaler |

S.26.16 — Intern model — Ændringer af modellen

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Formålet med dette skema er at indsamle oplysninger om karakteristika ved ændringer af modellen, som sker i henhold til den godkendte politik for ændring af modeller, og om hvordan solvenskapitalkravet har ændret sig i en årlig indberetningsperiode som følge af de ændringer, der blev gennemført i den pågældende periode. Denne periode kan adskille sig fra den periode, der er fastlagt ved politikken for ændring af modeller, f.eks. for akkumulering af mindre ændringer.

Mindre ændringer af modellen skal ikke tælles dobbelt inden for eller på tværs af indberetningsperioder. Hvis en betydelig ændring indeholder mindre ændringer eller er en akkumulering af mindre ændringer, foretages der derfor enten:

- en fjernelse af indvirkningen af disse mindre ændringer i den betydelige ændring, hvis de mindre ændringer blev gennemført i en tidligere indberetningsperiode, eller
- disse inkluderes i »de samlede mindre ændringer«, og deres virkning fjernes fra den betydelige ændring som følge af en akkumulering af virkningen af mindre ændringer.

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|------------|
|--|------|------------|

Type ændring

| | | |
|-------|-----------|---|
| C0010 | Betydelig | Oplysninger i denne række skal henvise til en betydelige ændring (i en given indberetningsperiode). En række betydelige ændringer kan samles i en enkelt <i>godkendelse</i> , men de bør adskilles i de tilfælde, hvor der er klare betydelige ændringer. Navngivningskonvention: betydelig ændring 1_Komponent 1 |
|-------|-----------|---|

Ændrings-ID

| | | |
|-------|-------------|--|
| C0020 | Ændrings-ID | Dette ændrings-ID bør være konsistent mellem indberetning som enkelt selskab og som koncern. Det anvendes for at matche de ændringer for enkeltsselskaber, der svarer til ændringen for koncernen i indberetningsperioden. |
|-------|-------------|--|

Beskrivelse af ændring

| | | |
|-------|--------------------------------------|--|
| C0030 | Godkendelsesdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor godkendelsen bevilges i henhold til beslutningen truffet af den berørte nationale kompetente myndighed. |
| C0040 | Indberetningsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den skriftlige anmodning om godkendelse til den berørte nationale kompetente myndighed (med henblik på godkendelse af ændringer) blev indgivet. |
| C0050 | Beskrivelse af ændring af politikken | En kort beskrivelse af ændringens art og hvilke aspekter af modellen, der er blevet ændret. |
| C0060 | Ændring som følge af | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ændring i risikoprofil 2 — Ændring i inputdata og antagelser 3 — Ændring i metode 4 — Andet |
| C0070 | Anden kategorisering og forklaring | Beskriv kategoriseringen, hvis denne er forskellig fra kolonne C0060. Hvis udfyldt, anvend valgmuligheden »Andet« under kolonne C0060. |
| C0080 | Indvirkning på markedsrisici | Hvis kapitalkravet for markedsrisici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0090 | KREDITrisiko ved finansielle instrumenter, indvirkning | Hvis kapitalkravet for kreditrisici ved finansielle instrumenter påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0100 | KREDITrisiko ved ikke-finansielle instrumenter, indvirkning | Hvis kapitalkravet for kreditrisici ved ikke-finansielle instrumenter påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0110 | Indvirkning på risici ved skades- og NSLT-sygeforsikring | Hvis kapitalkravet for risici ved skades- og NSLT-sygeforsikring påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0120 | Indvirkning på risici ved livs- og sygeforsikring | Hvis kapitalkravet for risici ved livs- og sygeforsikring påvirkes af en betydelig ændring i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0130 | Indvirkning på operationelle risici | Hvis kapitalkravet for operationelle risici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0140 | Indvirkning på pensionsrisici | Hvis kapitalkravet for pensionsrisici påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |
| C0150 | Indvirkning på afhængighedsstruktur og -korrelation | Hvis diversificeringsfordelene som følge af ændringer af afhængighedsstrukturen og/eller -korrelationen påvirkes af betydelige ændringer i modellen, anføres dette her. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: Ja Nej |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|--|
| C0160 | Anden begrundelse (fri tekst) | Beskriv, hvordan (eventuelle) andre modelbereggede bidrag til solvenskapitalkravet blev påvirket af ændringen af modellen. |
| C0170 | Ændringens betegnelse | En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Kvalitativ 2 — Kvantitativ 3 — Kombination af kvantitativ/kvalitativ |

Virksomheden af ændringer

| | | |
|-------|---|---|
| C0180 | Solvenskapitalkrav i alt før ændringer (beløb) | Solvenskapitalkrav i alt (fuldstændig modelberegning inklusive den del af standardformlen for partielle interne modeller og diversifikationsfordele) inden modelændring, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0190 | Referencedato for indvirkning på solvenskapitalkravet | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for referencedatoen for indvirkning på solvenskapitalkravet forårsaget af modelændringen (kun betydelige ændringer). Dato, som angives af de nationale kompetente myndigheder i brevet om godkendelse af anvendelsen af den betydelige ændring, og fra hvilken den godkendte model kan anvendes til beregning af solvenskapitalkravet. |
| C0200 | Solvenskapitalkrav i alt efter ændringer (beløb) | Solvenskapitalkrav i alt (om nødvendigt fuldstændig modelberegning inklusive den del af standardformlen for partielle interne modeller og diversifikationsfordele) efter modelændring, som angivet i ansøgningen om modelændring, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0210 | Den samlede ændring af solvenskapitalkravet i % | Den relative ændring af de samlede solvenskapitalkrav i procent. (kun betydelige ændringer) |
| C0220 | Kapitalgrundlag uden ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden modelændringer, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0540/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0660/C0010 for koncerner. |
| C0230 | Kapitalgrundlag med ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag med modelændringer, i indberetningsvalutaenheder. Indberet kun betydelige ændringer. Den forventede værdi er som i S.23.01.01.01 R0540/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0660/C0010 for koncerner. |
| C0260 | Anden udløsende værdi | Hvis ikke ændringen i solvenskapitalkravet er den udløsende værdi, der har ført til klassificeringen af betydelig ændring, angives der her, hvilke kriterier der klassificerer ændringen som betydelig (kun den relevante udløsende værdi, som førte til ændringen). |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|-------------------------------|---|
| C0270 | Anden udløsende værdi (beløb) | Beløb for indvirkningen af den udløsende værdi i C0260 (ud over solvenskapitalkravet) |
| C0280 | Anden udløsende værdi (i %) | Indvirkningen i procent med hensyn til den udløsende værdi i C0260 (ud over solvenskapitalkravet) |

Mindre ændringer

| | | |
|-------|---|---|
| C0220 | Kapitalgrundlag uden ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden mindre modelændringer |
| C0230 | Kapitalgrundlag med ændring (beløb) | Samlet anerkendt kapitalgrundlag uden mindre modelændringer plus summen af indvirkninger af de mindre modelændringer på det samlede anerkendte kapitalgrundlag i denne indberetningsperiode. |
| C0240 | Summen af solvenskapitalkrav for mindre ændringer, der øger solvenskapitalkravet | Summen af indvirkninger, men kun de mindre modelændringer, på de samlede solvenskapitalkrav, hvorved solvenskapitalkravet blev øget for denne indberetningsperiode. Referenceværdien for det anvendte solvenskapitalkrav er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0250 | Summen af solvenskapitalkrav for mindre ændringer, der reducerer solvenskapitalkravet | Summen af indvirkninger, men kun de mindre modelændringer, på de samlede solvenskapitalkrav, hvorved solvenskapitalkravet blev reduceret for denne indberetningsperiode, i indberetningsvalutaenheder. Referenceværdien for det anvendte solvenskapitalkrav er som i S.23.01.01.01 R0580/C0010 for enkeltsselskaber og som i S.23.01.04.01 R0680/C0010 for koncerner. |
| C0290 | Antal mindre ændringer, der er gennemført i indberetningsperioden | Antal mindre ændringer, der er gennemført i indberetningsperioden. |
| C0300 | Akkumuleringstærskel | Akkumuleringstærskel som anført i politikken for ændring af modeller. |
| C0310 | Nulstilling | Angiv, om der er sket en nulstilling af akkumuleringen af mindre ændringer i indberetningsperioden: <ul style="list-style-type: none"> — Nulstilling af mindre ændringer i forbindelse med den interne model i indberetningsperioden — Ingen nulstilling af mindre ændringer i forbindelse med den interne model i indberetningsperioden |
| C0320 | Årsagen til nulstilling | Anfør kort begrundelsen for, hvorfor der er sket en nulstilling af akkumuleringen af mindre ændringer i indberetningsperioden. |

S.27.01 — Solvenskapitalkrav — Skades- og sygeforsikringskatastroferisici

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner, ring-fenced fonde, matchtilpasningsporteføljer og resterende del.

Skema S.27.01 skal udfyldes for hver ring-fenced fond, hver matchtilpasningsportefølje og for den resterende del. Hvis der i en ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje indgår en matchtilpasningsportefølje/ring-fenced fond, bør fonden imidlertid behandles som særskilte fonde. Dette skema skal indberettes for alle afdelinger i en væsentlig ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje som angivet i anden tabel i S.01.03.

Skema SR.27.01 anvendes kun i forbindelse med ring-fenced fonde/matchtilpasningsporteføljer i selskaber konsolideret i henhold til artikel 335, stk. 1, litra a), b) og c), i delegeret forordning (EU) 2015/35, når metode 1 (metode baseret på regnskabskonsolidering) anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2 (metode med fradrag og aggregering).

Formålet med dette skema er at give indsigt i, hvordan katastroferisikomodulet i solvenskapitalkravet er blevet beregnet, og hvad de vigtigste elementer er.

For hver type katastroferisiko skal den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er bestemmes. Denne beregning er prospektiv og skal være baseret på genforsikringsprogrammet for det næste regnskabsår som beskrevet i genforsikringsskemaerne for fakultative dækninger (S.30.01 og S.30.02 i bilag II) og cederede genforsikringsprogrammer i det næste regnskabsår (S.30.03 og S.30.04 i bilag II).

Selskaberne skal foretage et skøn over deres genindvinding fra risikoreduktion i overensstemmelse med direktiv 2009/138/EF, delegeret forordning (EU) 2015/35 og relevante tekniske standarder. Selskaberne skal kun udfylde katastrofeindberetningsskemaet med den detaljeringsgrad, der er nødvendig for at foretage denne beregning.

I skades- og sygeforsikringsrisikomodulet defineres katastroferisiko som tabsrisiko eller risiko for en negativ udvikling i værdien af forsikringsforpligtelser som følge af betydelig usikkerhed omkring antagelser vedrørende præmier og hensættelser relateret til ekstreme eller usædvanlige begivenheder, jf. artikel 105, stk. 2, litra b), og stk. 4, litra c), i direktiv 2009/138/EF.

Det indberettede kapitalkrav afspejler kapitalkravene før og efter risikoreduktion, hvilket er den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er. Det indberettede kapitalkrav efter risikoreduktion angives, uden at der tages hensyn til de forsikringsmæssige hensættelsers tabsabsorberende evne. Standardværdien af risikoreduktionen skal indberettes som en positiv værdi for at kunne fratrækkes.

Hvis diversifikationseffekten nedsætter kapitalkravet, indberettes standardværdien for diversifikationen som en negativ værdi.

For indberetning på koncernniveau skal følgende specifikke krav opfyldes:

- a) Oplysningerne indberettes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, enten alene eller i kombination med metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF.
- b) Når der anvendes en kombination, skal oplysningerne kun indberettes for den del af koncernen, der beregnes med metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF.
- c) Oplysningerne skal ikke indberettes for koncerner, når kun metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes.

| | | |
|---|---|--|
| Z0020 | Ring-fenced fond, matchtilpasningsportefølje eller resterende del | <p>Angiver, om de indberettede tal vedrører en ring-fenced fond, en matchtilpasningsportefølje eller den resterende del. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ring-fenced fond/matchtilpasningsportefølje</p> <p>2 — Resterende del</p> |
| Z0030 | Fonds-/porteføljenummer | <p>Hvis post Z0020 = 1, angives her identifikationsnummeret for en ring-fenced fond eller en matchtilpasningsportefølje. Dette nummer tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og skal være konsistent over tid og stemme overens med det fonds- eller porteføljenummer, der er indberettet i andre skemaer.</p> |
| R0001/C0001 | Anvendte forenklinger — brandrisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn ved SCR-beregningen, har anvendt forenklinger ved beregningen af brandrisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Forenklinger med henblik på artikel 90c</p> <p>9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Hvis R0001/C0001 = 1, udfyldes kun C0880 med henblik på R2600.</p> |
| R0002/C0001 | Anvendte forenklinger — naturkatastroferisici | <p>Angiv, hvorvidt et selskab, der er omfattet af koncerntilsyn ved SCR-beregningen, har anvendt forenklinger ved beregningen af naturkatastroferisici. Følgende valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — Forenkling med henblik på artikel 90b — storm</p> <p>2 — Forenkling med henblik på artikel 90b — jordskælv</p> <p>3 — Forenkling med henblik på artikel 90b — oversvømmelse</p> <p>4 — Forenkling med henblik på artikel 90b — hagl</p> <p>5 — Forenkling med henblik på artikel 90b — jordskred</p> <p>9 — Forenklinger ikke anvendt</p> <p>Valgmulighed 1 til 5 kan anvendes samtidigt.</p> |
| <i>Skadesforsikringskatastroferisici — Oversigt</i> | | |
| C0010/R0010 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Naturkatastroferisici | <p>Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0070.</p> |

| | | |
|-------------------|--|---|
| C0010/R0020–R0060 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. naturkatastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner. Pr. naturkatastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion. |
| C0010/R0070 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0020/R0010 | Samlet risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0070. |
| C0020/R0020–R0060 | Samlet risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. naturkatastroferisiko. |
| C0020/R0070 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0030/R0010 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle naturkatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0070. |
| C0030/R0020–R0060 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Naturkatastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. naturkatastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner. Pr. naturkatastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0070 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige naturkatastroferisici. |
| C0010/R0080 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Katastroferisiko vedrørende ikkeproportional ejendomsforsikring | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| C0020/R0080 | Samlet risikoreduktion — katastroferisiko i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende ikkeproportional ejendomsforsikring. |

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0030/R0080 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — katastroferisiko i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til ikkeproportional ejendomsforsikring. |
| C0010/R0090 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0160. |
| C0010/R0100–R0150 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. menneskeskabt katastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem områder og regioner. Pr. menneskeskabt katastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion. |
| C0010/R0160 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |
| C0020/R0090 | Samlet risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0160. |
| C0020/R0100–R0150 | Samlet risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. menneskeskabt naturkatastroferisiko. |
| C0020/R0160 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |
| C0030/R0090 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle menneskeskabte katastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0160. |
| C0030/R0100–R0150 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Menneskeskabte katastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. menneskeskabt katastroferisiko under hensyn til diversifikationseffekten mellem delrisici. Pr. menneskeskabt katastroferisiko er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0160 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige menneskeskabte katastroferisici. |

| | | |
|-------------|--|--|
| C0010/R0170 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0010/R0180. |
| C0010/R0180 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0170 | Samlet risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0180. |
| C0020/R0180 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0030/R0170 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Andre skadesforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle andre skadesforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0030/R0180. |
| C0030/R0180 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem risici | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige andre skadesforsikringskatastroferisici. |
| C0010/R0190 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |
| C0010/R0200 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |
| C0010/R0210 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0010/R0200. |
| C0020/R0190 | Samlet risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |

| | | |
|--|--|--|
| C0020/R0200 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |
| C0020/R0210 | Samlet risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0020/R0200. |
| C0030/R0190 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici før diversifikation | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) før diversifikationseffekten mellem delmodulerne. |
| C0030/R0200 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler. | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici). |
| C0030/R0210 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — I alt for skadesforsikringskatastroferisici efter diversifikation | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmodulerne (naturkatastrofer, ikkeproportional ejendomsforsikring, menneskabte katastroferisici og andre skadesforsikringskatastroferisici) under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0030/R0200. |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Oversigt | | |
| C0010/R0300 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt før risikoreduktion i tilknytning til alle sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0010/R0340. |
| C0010/R0310–R0330 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici under hensyn til diversifikationseffekten mellem landene. Pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko før risikoreduktion. |

| | | |
|-----------------------------------|---|---|
| C0010/R0340 | Solvenskapitalkrav før risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0300 | Samlet risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til alle delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem risici, jf. C0020/R0340. |
| C0020/R0310–R0330 | Samlet risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0020/R0340 | Samlet risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| C0030/R0300 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Sygeforsikringskatastroferisici | Katastroferisici i alt efter risikoreduktion i tilknytning til alle delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici og under hensyn til diversifikationseffekten mellem delmodulerne, jf. C0030/R0340. |
| C0030/R0310–R0330 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici under hensyn til diversifikationseffekten mellem landene. Pr. delmodul for sygeforsikringskatastroferisici er dette beløb lig med kapitalkravet for katastroferisiko efter risikoreduktion. |
| C0030/R0340 | Solvenskapitalkrav efter risikoreduktion — Diversifikation mellem delmoduler. | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige delmoduler for sygeforsikringskatastroferisici. |
| Skadesforsikringskatastroferisici | | |
| Naturkatastroferisici — Storm | | |

| | | |
|-------------------|--|---|
| C0040/R0610–R0780 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene vedrørende de 14 andre regioner ud over specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne, brand og andre skader på ejendom dækkende stormrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, og sø-, luftfarts- og transportforsikring dækkende skade på landbaseret ejendom forårsaget af storm, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser.</p> <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0040/R0790 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | <p>Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen skal tjene det følgende år før diversifikation for de 14 andre regioner end de specificerede-regioner.</p> |
| C0050/R0400–R0590 | Eksponering — specificeret-region | <p>Den samlede forsikringssum for hver af de 23 specificerede-regioner for brancherne:</p> <p>brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker stormrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region, og</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af storm, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region.</p> |
| C0050/R0600 | Eksponering — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | <p>Samlet eksponering før diversifikation for de 23 specificerede-regioner.</p> |
| C0060/R0400–R0590 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | <p>Specificeret bruttotab vedrørende storm for hver af de 23 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne.</p> |
| C0060/R0600 | Specificeret bruttotab — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | <p>Samlet specificeret bruttotab før diversifikation for de 23 specificerede-regioner.</p> |
| C0070/R0400–R0590 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | <p>Kapitalkravsfaktor for hver af de 23 specificerede-regioner ved risiko for storm, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne.</p> |
| C0070/R0600 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for storm for specificerede-regioner før diversifikation | <p>Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering.</p> |
| C0080/R0400–R0590 | Scenario A eller B — specificeret-region | <p>Den største værdi af kapitalkravet for stormrisici for hver af de 23 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B.</p> <p>Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko.</p> |

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0090/R0400–R0590 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for hver af de 23 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |
| C0090/R0600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for de 23 specificerede-regioner. |
| C0090/R0790 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for øvrige regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for stormrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0090/R0800 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til storm for alle regioner. |
| C0090/R0810 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af stormrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0090/R0820 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Storm i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for stormrisici under hensyn til diversifikationseffekten som indberettet under post C0090/R0810. |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0100/R0400–R0590 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 23 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0100/R0600 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion i tilknytning til storm for de 23 specificerede-regioner. |
| C0100/R0790 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0100/R0800 | Skønnet risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion i tilknytning til storm for alle regioner. |
| C0110/R0400–R0590 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 23 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, for det valgte scenario, i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0110/R0600 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 23 specificerede-regioner. |
| C0110/R0790 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0110/R0800 | Skønnede genindsættelsespræmier — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0120/R0400–R0590 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende storm i hver af de specificerede-regioner, for det valgte scenario. |

| | | |
|--------------------------------------|---|---|
| C0120/R0600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 23 specificerede-regioner. |
| C0120/R0790 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for stormrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0120/R0800 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |
| C0120/R0810 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for stormrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0120/R0820 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Storm i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for stormrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0120/R0810. |
| Naturkatastroferisici — Jordskælv | | |
| C0130/R1040– R1210 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene vedrørende hver af de 14 andre regioner ud over specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne:</p> <p>brand og andre skader på ejendom dækkende jordskælvsrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, og</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af jordskælv, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser.</p> <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0130/R1220 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for jordskælv for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene for de andre regioner. |
| C0140/R0830–R1020 | Eksponering — specificeret-region | Den samlede forsikringssum for hver af de 20 specificerede-regioner for brancherne: brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker jordskælvsrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region, og For brancherne luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på land-baseret ejendom forårsaget af jordskælv, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0140/R1030 | Eksponering — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksponering for de 20 specificerede-regioner. |
| C0150/R0830–R1020 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende jordskælv for hver af de 20 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0150/R1030 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0160/R0830–R1020 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 20 specificerede-regioner ved risiko for jordskælv efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0160/R1030 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0170/R0830–R1020 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv i hver af de 20 specificerede-regioner. |

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0170/R1030 | Kapitalkrav for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0170/R1220 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for jordskælvsrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0170/R1230 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til jordskælv for alle regioner. |
| C0170/R1240 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af jordskælvsrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0170/R1250 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for jordskælvsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0170/R1240. |
| C0180/R0830–R1020 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 20 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0180/R1030 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 20 specificerede-regioner. |
| C0180/R1220 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0180/R1230 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0190/R0830–R1020 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 20 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0190/R1030 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 20 specificerede-regioner. |
| C0190/R1220 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0190/R1230 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0200/R0830–R1020 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv i hver af de 20 specificerede-regioner. |
| C0200/R1030 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv for de 20 specificerede-regioner. |
| C0200/R1220 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskælvsrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | | |
|--|--|--|
| C0200/R1230 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskælv for alle regioner. |
| C0200/R1240 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for jordskælvsrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0200/R1250 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskælv efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskælvsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0200/R1240. |
| <i>Naturkatastroferisici — Oversvømmelse</i> | | |
| C0210/R1410–R1580 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene vedrørende hver af de 14 andre regioner ud over specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne: brand og andre skader på ejendom dækkende oversvømmelsesrisici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler. |
| C0210/R1590 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene for de andre regioner. |
| C0220/R1260–R1390 | Eksponering — specificeret-region | Den samlede forsikringssum for hver af de 14 specificerede-regioner for brancherne: brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker oversvømmelsesrisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. og anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, ganget med 1,5, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af oversvømmelse, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. |
| C0220/R1400 | Eksponering — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksponering for de 14 specificerede-regioner. |
| C0230/R1260–R1390 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende oversvømmelse for hver af de 14 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0230/R1400 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende oversvømmelse for de 14 specificerede-regioner. |
| C0240/R1260–R1390 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 14 specificerede-regioner ved risiko for oversvømmelse efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0240/R1400 | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0250/R1260–R1390 | Scenario A eller B — specificeret-region | Den største værdi af kapitalkravet for oversvømmelsesrisici for hver af de 14 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B. Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko. |
| C0260/R1260–R1390 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for hver af de 14 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |
| C0260/1400 | Kapitalkrav for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for de 14 specificerede-regioner. |
| C0260/R1590 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for oversvømmelsesrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0260/R1600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til oversvømmelse for alle regioner. |
| C0260/R1610 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af oversvømmelsesrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0260/R1620 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for oversvømmelsesrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0260/R1610. |
| C0270/R1260–R1390 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 14 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0270/R1400 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 14 specificerede-regioner. |
| C0270/R1590 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0270/R1600 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |
| C0280/R1260–R1390 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 14 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, svarende til det valgte scenario, i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0280/R1400 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 14 specificerede-regioner. |
| C0280/R1590 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — Andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0280/R1600 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for oversvømmelse — Alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0290/R1260–R1390 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende oversvømmelse i hver af de 14 specificerede-regioner, for det valgte scenario. |
| C0290/R1400 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 14 specificerede-regioner. |
| C0290/R1590 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — Andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | | |
|---|--|---|
| C0290/R1600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse — Alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |
| C0290/R1610 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikations-effekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0290/R1620 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for oversvømmelse efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for oversvømmelsesrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0290/R1610. |
| <i>Naturkatastroferisici</i> — <i>Hagl</i> | | |
| C0300/R1730– R1900 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Andre regioner | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene vedrørende hver af de 9 andre regioner ud over specificerede-regioner (inklusive regioner som anført i bilag III, men eksklusive de regioner, der er anført i bilag V eller i bilag XIII til delegeret forordning (EU) 2015/35) for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brancherne:</p> <p>brand og andre skader på ejendom dækkende haglrисici, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring dækkende skader på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. og</p> <p>anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser.</p> <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |
| C0300/R1910 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Det samlede skøn over præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene for de andre regioner. |

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0310/R1630–R1710 | Eksponering — specificeret-region | <p>Den samlede forsikringssum for hver af de 11 specificerede-regioner for brancherne:</p> <p>brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker haglisici, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region. og</p> <p>anden motorforsikring, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, ganget med 5, i tilknytning til kontrakter, der dækker skade på landbaseret ejendom forårsaget af hagl, og hvor risikoen består i denne bestemte specificerede-region.</p> |
| C0310/R1720 | Eksponering — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet eksponering for de 11 specificerede-regioner. |
| C0320/R1630–R1710 | Specificeret bruttotab — specificeret-region | Specificeret bruttotab vedrørende hagl for hver af de 11 specificerede-regioner under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0320/R1720 | Specificeret bruttotab — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet specificeret bruttotab vedrørende hagl for de 11 specificerede-regioner. |
| C0330/R1630–R1710 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkravsfaktor for hver af de 9 specificerede-regioner ved risiko for hagl efter standardformlen, under hensyn til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0330/R1720 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Forholdet mellem samlet specificeret bruttotab og samlet eksponering. |
| C0340/R1630–R1710 | Scenario A eller B — specificeret-region | <p>Den største værdi af kapitalkravet for haglisici for hver af de 11 specificerede-regioner ifølge scenario A eller scenario B.</p> <p>Ved afgørelsen af, om scenario A eller B er størst, skal der tages hensyn til den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko.</p> |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0350/R1630–R1710 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for hver af de 11 specificerede-regioner — værdien for scenario A eller B, afhængigt af hvilken der er størst. |
| C0350/R1720 | Katastroferisikofaktor før risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for de 11 specificerede-regioner. |
| C0350/R1910 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for haglrисici i andre regioner end specificerede-regioner. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0350/R1920 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til hagl for alle regioner. |
| C0350/R1930 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af haglrисici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede-regioner og andre regioner). |
| C0350/R1940 | Kapitalkrav for katastroferisici for risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for haglrисici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0350/R1930. |
| C0360/R1630–R1710 | Skønnet risikoreduktion — specificeret-region | For hver af de 11 specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning, for det valgte scenario, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0360/R1720 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for de 11 specificerede-regioner. |
| C0360/R1910 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C0360/R1820 | Skønnet risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet skønnet risikoreduktion for alle regioner. |
| C0370/R1630–R1710 | Skønnede genindsættelsespræmier — specificeret-region | For hver af de 11 specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier, svarende til det valgte scenario, i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0370/R1720 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for de 11 specificerede-regioner. |
| C0370/R1910 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | For alle regioner ud over specificerede-regioner de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0370/R1920 | Skønnede genindsættelsespræmier — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlede skønnede genindsættelsespræmier for alle regioner. |
| C0380/R1630–R1710 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — specificeret-region | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af selskabets specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende hagl i hver af de 11 specificerede-regioner, for det valgte scenario. |
| C0380/R1720 | Kapitalkrav for katastroferisiko efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for specificerede-regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for de 11 specificerede-regioner. |
| C0380/R1910 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for andre regioner før diversifikation | Kapitalkrav efter risikoreduktion for haglrисici i andre regioner end specificerede regioner. Det umiddelbare tab inklusive fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0380/R1920 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl for alle regioner før diversifikation | Samlet kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle regioner. |

| | | |
|--------------------------------------|--|---|
| C0380/R1930 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem regioner | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for haglrисici vedrørende de forskellige regioner (både specificerede regioner og andre regioner). |
| C0380/R1940 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Den samlede værdi for hagl efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for haglrисici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0380/R1930. |
| Naturkatastroferisici — Jordskred | | |
| C0390/R1950 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Jordskred i alt før diversifikation | Et skøn over de præmier, der det følgende år skal tjenes af forsikrings- eller genforsikringskoncernen for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende brand og anden skade på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser. Præmierne skal angives brutto, uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler, vedrørende Frankrigs territorium. |
| C0400/R1950 | Eksposering — Jordskred i alt før diversifikation | Den samlede forsikringssum for de geografiske opdelinger af Frankrigs territorium vedrørende brand og andre skader på ejendom, herunder de proportionale genforsikringsforpligtelser, som er tilstrækkeligt homogene i tilknytning til den jordskredsrisiko, som forsikrings- og genforsikringskoncernerne er eksponeret for vedrørende territoriet. Områderne lagt sammen udgør det samlede territorium. |
| C0410/R1950 | Specificeret bruttotab — Jordskred i alt før diversifikation | Specificeret bruttotab vedrørende jordskred før hensyntagen til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0420/R1950 | Kapitalkravsfaktor for katastroferisiko før risikoreduktion — Den samlede værdi for jordskred før diversifikation | Kapitalkravsfaktor for Frankrigs territorium ved risiko for jordskred, før hensyntagen til diversifikationseffekten mellem områderne. |
| C0430/R1950 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Kapitalkravet før risikoreduktion for jordskredsrisici på Frankrigs territorium. Det umiddelbare tab, uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, som for jordskred er lig med de specificerede bruttotab (post C0410/R1950). |
| C0430/R1960 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem områder — Jordskred i alt før diversifikation | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af jordskredsrisici vedrørende de forskellige områder på Frankrigs territorium. |

| | | |
|--|--|---|
| C0430/R1970 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Jordskred i alt — Jordskred i alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion for jordskredsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0430/R1960. |
| C0440/R1950 | Skønnet risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0450/R1950 | Skønnede genindsættelsespræmier — Jordskred i alt før diversifikation | De skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C0460/R1950 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Jordskred i alt før diversifikation | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende jordskred. |
| C0460/R1960 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem områder | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for jordskredsrisici vedrørende de forskellige områder på Frankrigs territorium. |
| C0460/R1970 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Jordskred i alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for jordskredsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C0460/R1960. |
| <i>Naturkatastroferisici — Ikkeproportional ejendomsforsikring</i> | | |
| C0470/R2000 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes | Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene, for så vidt angår kontrakten i tilknytning til forpligtelserne vedrørende branchen ikkeproportional ejendomsforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler. |

| | | |
|--|---|--|
| C0480/R2000 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkravet før risikoreduktion for ikkeproportional ejendomsgenforsikring. Det umiddelbare tab uden fradrag af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C0490/R2000 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0500/R2000 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |
| C0510/R2000 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til accepteret ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Motoransvar</i> | | |
| C0520/R2100 | Antal køretøjer — policegrænse over 24 mio. EUR | Antal køretøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen i brancher, motoransvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, med en vurderet policegrænse på over 24 000 000 EUR. |
| C0530/R2100 | Antal køretøjer — policegrænse under eller lig med 24 mio. EUR | Antal køretøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen i brancher, motoransvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, med en vurderet policegrænse på under eller lig med 24 000 000 EUR. |
| C0540/R2100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til motoransvarsforsikring. |
| C0550/R2100 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0560/R2100 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring. |
| C0570/R2100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til motoransvarsforsikring efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til motoransvarsforsikring. |

| | | |
|--|---|--|
| <p>Menneskeskabte katastroferisici — Tank-skibskollision</p> | | |
| <p>C0580/R2200</p> | <p>Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion for dækningstypen kaskoforsikring for tank-skib t</p> | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion for hver kaskoforsikring for risici i tilknytning til tankskibskollision.</p> <p>Maksimum vedrører alle olie- og gastankskibe, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen med hensyn til tankskibskollision i brancherne:</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og</p> <p>ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring</p> <p>Beløbet for denne dækning er lig med den forsikringssum, som er accepteret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen for søforsikring og -genforsikring for hvert tankskib.</p> |
| <p>C0590/R2200</p> | <p>Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søansvarsforsikring for tankskib t før risikoreduktion</p> | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion pr. søansvarsforsikringsdækning vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision.</p> <p>Maksimum vedrører alle olie- og gastankskibe, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen med hensyn til tankskibskollision i brancherne:</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og</p> <p>ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring</p> <p>Beløbet for denne dækning er lig med den forsikringssum, som er accepteret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen for søforsikring og -genforsikring for hvert tankskib.</p> |
| <p>C0600/R2200</p> | <p>Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion for søansvarsforsikring for olieforurening for tankskib t</p> | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion pr. søansvarsforsikringsdækning vedrørende risici i tilknytning til olieforurening forårsaget af tankskibskollision.</p> <p>Maksimum vedrører alle olie- og gastankskibe, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen med hensyn til tankskibskollision i brancherne:</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og</p> <p>ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring</p> <p>Beløbet for denne dækning er lig med den forsikringssum, som er accepteret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen for søforsikring og -genforsikring for hvert tankskib.</p> |

| | | |
|---|---|---|
| C0610/R2200 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0620/R2200 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0630/R2200 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0640/R2200 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til tankskibskollision efter risikoreduktion | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til tankskibskollision. |
| C0650/R2200 | Fartøjets navn | Navnet på det pågældende fartøj. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Offshoreplatformsekspllosion</i> | | |
| C0660–C0700/ R2300 | Kapitalkrav for katastroferisiko i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion — <i>Dækningstype</i> — før risikoreduktion | <p>Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype (skade på ejendom, fjernelse af vragester, tab af produktionsindtægter, afdækning eller sikring af borehullet, ansvarsforsikring og genforsikringsforpligtelser), vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion.</p> <p>Maksimum vedrører alle offshore olie- og gasplatforme, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen med hensyn til platformsekspllosion i brancherne:</p> <p>luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og</p> <p>ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring</p> <p>Beløbet pr. dækningstype er lig med forsikringssummen for den specifikke dækningstype accepteret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen vedrørende den valgte platform.</p> |
| C0710/R2300 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0720/R2300 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |

| | | |
|---|---|---|
| C0730/R2300 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0740/R2300 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til offshoreplatformsekspllosion. |
| C0750/R2300 | Platformens navn | Navnet på den pågældende platform. |
| <i>Antal fartøjer</i> | | |
| C0781/R2421 | Antal fartøjer under tærsklen på 250 000 EUR | Det antal fartøjer, der befinder sig under tærsklen på 250 000 EUR |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Søforsikring</i> | | |
| C0760/R2400 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikring. |
| C0760/R2410 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for søforsikringsrisici. |
| C0760/R2420 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |
| C0770/R2400 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til søforsikringsrisici. |
| C0780/R2400 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |

| | | |
|---|---|---|
| C0780/R2410 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for søforsikringsrisici. |
| C0780/R2420 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til søforsikring efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for søforsikringsrisici. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Luftfart</i> | | |
| C0790–C0800/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisiko i tilknytning til luftfart før risikoreduktion — Dækningstype — for risikoreduktion | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype (kaskoforsikring og ansvarsforsikring), for risici i tilknytning til luftfart. Maksimum vedrører alle luftfartøjer, som er forsikret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen: luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser og ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring Beløbet pr. dækningstype er lig med forsikringssummen for den specifikke dækningstype accepteret af forsikrings- eller genforsikringskoncernen vedrørende luftfartsforsikring og -genforsikring og i tilknytning til det valgte luftfartøj. |
| C0810/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart før risikoreduktion | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |
| C0820/R2500 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til luftfart, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0830/R2500 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |
| C0840/R2500 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til luftfart efter risikoreduktion — I alt (række) | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til luftfart. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Brand</i> | | |

| | | |
|--|--|--|
| C0850/R2600 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand før risikoreduktion | <p>Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til brandrisici.</p> <p>Beløbet er lig med en forsikrings- eller genforsikringskoncerns største brandrisikokoncentration, dvs. det sæt bygninger med den største forsikringssum, der opfylder følgende betingelser:</p> <p>Forsikrings- eller genforsikringskoncernen har forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser i branchen, brand og anden skade på ejendom, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, vedrørende de enkelte bygninger, som dækker skade som følge af brand eller eksplosion, herunder som følge af terrorangreb.</p> <p>Alle bygninger ligger helt eller delvist inden for en radius af 200 meter.</p> |
| C0860/R2600 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til brand, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0870/R2600 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til brand. |
| C0880/R2600 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til brand efter risikoreduktion | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til brand. |
| Menneskeskabte katastroferisici — Ansvar | | |
| C0890/R2700–R2740 | Præmieindtægter følgende 12 måneder — Dækningstype | <p>Forsikrings- eller genforsikringskoncernens præmieindtægter, pr. dækningstype, i de efterfølgende 12 måneder vedrørende forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for ansvarsrisiko, for følgende dækningstyper:</p> <p>erhvervsansvarsforsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen erhvervsansvarsforsikring og -genforsikring for selvstændige håndværkere</p> <p>forsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende arbejdsgiveransvar</p> <p>forsikringsforpligtelser og proportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende bestyrelsesansvar</p> <p>ansvarsforsikrings- og ansvarsgenforsikringsforpligtelser, der indgår i brancher, almindelig ansvarsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen forpligtelser, der er omfattet af ansvarsrisikogruppe 1-3, og undtagen personlig ansvarsforsikring og proportional genforsikring og undtagen erhvervsansvarsforsikring og -genforsikring for selvstændige håndværkere</p> <p>ikkeproportional genforsikring.</p> <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |

| | | |
|-------------------|---|---|
| C0890/R2750 | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder — I alt | Forsikrings- eller genforsikringskoncernens præmieindtægter i alt for alle dækningstyper, i de efterfølgende 12 måneder. |
| C0900/R2700–R2740 | Højeste ydede ansvarsgrænse — Dækningstype | Højeste ansvarsgrænse, pr. dækningstype, ydet af forsikrings- eller genforsikringskoncernen vedrørende ansvarsrisici. |
| C0910/R2700–R2740 | Antal krav — Dækningstype | Antal krav pr. dækningstype — er lig med det laveste heltal, der overstiger den ved den givne formel beregnede størrelse. |
| C0920/R2700–R2740 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — Dækningstype | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. dækningstype, for ansvarsrisici. |
| C0920/R2750 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt | Kapitalkrav i alt for alle dækningstyper før risikoreduktion vedrørende ansvarsrisici. |
| C0930/R2700–R2740 | Skønnet risikoreduktion — Dækningstype | Den skønnede risikoreducerende virkning, pr. dækningstype, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til ansvar, eksklusiv de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C0930/R2750 | Skønnet risikoreduktion — I alt | Skønnet risikoreduktion i alt for alle dækningstyper. |
| C0940/R2700–R2740 | Skønnede genindsættelsespræmier — Dækningstype | De skønnede genindsættelsespræmier, pr. dækningstype, vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0940/R2750 | Skønnede genindsættelsespræmier — I alt | Skønnede genindsættelsespræmier i alt for alle dækningstyper. |
| C0950/R2700–R2740 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — Dækningstype | Kapitalkrav, pr. dækningstype, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0950/R2750 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt | Det samlede kapitalkrav for alle dækningstyper, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er, vedrørende risici i tilknytning til ansvar. |
| C0960/R2800 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |

| | | |
|--|--|--|
| C0960/R2810 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — Diversifikation mellem dækningstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige dækningstyper for ansvarsrisici. |
| C0960/R2820 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| C0970/R2800 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den skønnede risikoreduktion i alt, før diversifikationseffekten mellem dækningstyper, for ansvarsrisici. |
| C0980/R2800 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| C0980/R2810 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — Diversifikation mellem dækningstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige dækningstyper for ansvarsrisici. |
| C0980/R2820 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til ansvar efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for ansvarsrisici. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Kredit og kaution</i> | | |
| C0990/R2900–R2910 | Eksposering (på individuelt niveau eller koncernniveau) — Største eksposering | Forsikrings- eller genforsikringskoncernens to største bruttokreditforsikringseksponeringer på grundlag af en sammenligning af nettotabet givet misligholdelse af kreditforsikringseksponeringerne, hvilket er lig med tabet givet misligholdelse efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |

| | | |
|-------------------|---|--|
| C0990/R2920 | Eksposering (på individuelt niveau eller koncernniveau) — I alt | Forsikrings- eller genforsikringskoncernens to største bruttokreditforsikringseksponeringer i alt på grundlag af en sammenligning af nettotabet givet misligholdelse af kreditforsikringseksponeringerne, hvilket er lig med tabet givet misligholdelse efter fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C1000/R2900–R2910 | Andel af skade forårsaget af scenario — Største eksposering | Den procentvise andel af tab givet misligholdelse i forhold til bruttokrediteksponeringen uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er, for hver af forsikrings- eller genforsikringskoncernens to største bruttokreditforsikringseksponeringer. |
| C1000/R2920 | Andel af skade forårsaget af scenario — I alt | Gennemsnitligt tab givet misligholdelse for de to største bruttokrediteksponeringer uden fradrag af de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler/fra SPV'er. |
| C1010/R2900–R2910 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — Største eksposering | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. største eksposering, vedrørende scenariet stor kreditmisligholdelse i tilknytning til kredit- og kautionrisici. |
| C1010/R2920 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici før risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — I alt | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende scenariet stor kreditmisligholdelse i tilknytning til kredit- og kautionrisici. |
| C1020/R2900–R2910 | Skønnet risikoreduktion — Største eksposering | Den skønnede risikoreducerende virkning, pr. største eksposering, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1020/R2920 | Skønnet risikoreduktion — I alt | Den skønnede risikoreducerende virkning, for de to største eksposeringer, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1030/R2900–R2910 | Skønnede genindsættelsespræmier — Største eksposering | De skønnede genindsættelsespræmier, pr. største eksposering, for koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici. |
| C1030/R2920 | Skønnede genindsættelsespræmier — I alt | De skønnede genindsættelsespræmier, for de to største eksposeringer, for koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici. |
| C1040/R2900–R2910 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — Største eksposering | Nettokapitalkrav, pr. største eksposering, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici. |
| C1040/R2920 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionrisici efter risikoreduktion — Stor kreditmisligholdelse — I alt | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet stor kreditmisligholdelse inden for kredit- og kautionrisici. |

| | | |
|-------------|--|---|
| C1050/R3000 | Præmieindtægter de efterfølgende 12 måneder | Forsikrings- eller genforsikringskoncernens bruttopræmieindtægter de efterfølgende 12 måneder i brancherne, kredit- og kautionsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser. |
| C1060/R3000 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Recessionsrisici | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion vedrørende scenariet recessionsrisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici. |
| C1070/R3000 | Skønnet risikoreduktion | Den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1080/R3000 | Skønnede genindsættelsespræmier | De skønnede genindsættelsespræmier vedrørende koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1090/R3000 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Recessionsrisici | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke retrocessionsaftaler og SPV'er vedrørende risici i tilknytning til scenariet recession inden for kredit- og kautionsrisici. |
| C1100/R3100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |

| | | |
|--|--|---|
| C1100/R3110 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for kredit- og kautionsrisici. |
| C1100/R3120 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| C1110/R3100 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3100 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3110 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — Diversifikation mellem begivenhedstyper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige begivenhedstyper for kredit- og kautionsrisici. |
| C1120/R3120 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til kredit- og kautionsrisici efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem begivenhedstyper, for kredit- og kautionsrisici. |
| <i>Menneskeskabte katastroferisici — Andre skadesforsikringskatastroferisici</i> | | |
| C1130/R3200–R3240 | Skøn over bruttopræmier, som skal tjenes — Forpligtelsesgruppe | <p>Et skøn over de præmier, som forsikrings- eller genforsikringskoncernen det følgende år skal tjene for så vidt angår kontrakter vedrørende følgende forpligtelsesgrupper:</p> <p>forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for brancherne, luftfarts-, sø- og transportforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen søforsikring og -genforsikring og luftfartsforsikring og -genforsikring</p> <p>genforsikringsforpligtelser inden for brancherne ikkeproportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring, undtagen søgenforsikring og luftfartsgenforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>forsikrings- og genforsikringsforpligtelser inden for brancherne diverse økonomiske tab, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser, undtagen udvidede garantiforsikrings- og -genforsikringsforpligtelser, forudsat at porteføljen af disse forpligtelser er meget diversificeret, og disse forpligtelser ikke omfatter udgifterne til produkttilbagekaldelser</p> <p>genforsikringsforpligtelser inden for brancherne ikkeproportional ulykkesgenforsikring, undtagen almindelig ansvarsgenforsikring, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>ikkeproportionale genforsikringsforpligtelser vedrørende forsikringsforpligtelser inden for brancherne kredit- og kautionsforsikring, inklusive proportionale genforsikringsforpligtelser.</p> <p>Præmierne angives brutto uden fradrag af præmier for genforsikringsaftaler.</p> |

| | | |
|-------------------|---|--|
| C1140/R3200–R3240 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — Forpligtelsesgruppe | Kapitalkravet før risikoreduktion, pr. forpligtelsesgruppe, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3250 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3260 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til forskellige forpligtelsesgrupper inden for andre skadeskatastroferisici. |
| C1140/R3270 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici før risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1150/R3250 | Skønnet samlet risikoreduktion — I alt før diversifikation | Den samlede skønnede risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3250 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — I alt før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3260 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikation mellem forpligtelsesgrupper | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af de samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til forskellige forpligtelsesgrupper inden for andre skadeskatastroferisici. |
| C1160/R3270 | Kapitalkrav for katastroferisici i tilknytning til andre skadeskatastroferisici efter risikoreduktion — I alt efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem forpligtelsesgrupper, for andre skadeskatastroferisici. |

| | | |
|---|--|---|
| Sygeforsikringskatastroferisici | | |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Masseulykker | | |
| C1170/R3300–R3600, C1190/R3300–R3600, C1230/R3300–R3600, C1250/R3300–R3600 | Forsikringstagere — Pr. begivenhedstype | Alle forsikrings- eller genforsikringskoncernens forsikrede, som er indbyggere i hvert af landene og er forsikret mod følgende begivenhedstyper: Dødsfald forårsaget af en ulykke Permanent invaliditet forårsaget af en ulykke Invaliditet, som varer 12 måneder, forårsaget af en ulykke Medicinsk behandling i tilknytning til en ulykke. |
| C1180/R3300–R3600, C1200/R3300–R3600, C1240/R3300–R3600, C1260/R3300–R3600 | Værdi af ydelser, som skal betales — Pr. begivenhedstype | Værdi af ydelserne er forsikringssummen eller, hvis forsikringsaftalen omfatter tilbagevendende ydelsesbetalinger, det bedste skøn over ydelsesbetalingerne, beregnet ved hjælp af cash flow-fremskrivning, pr. begivenhedstype. Hvis ydelserne i henhold til en forsikringsaftale afhænger af arten eller omfanget af en skade som følge af begivenhedstyper, baseres beregningen af værdien af ydelserne på de højeste ydelser, som kan opnås i henhold til aftalen, og som stemmer overens med begivenheden. For forsikrings- og genforsikringsforpligtelser vedrørende udgifter til lægebehandling baseres værdien af ydelserne på et skøn over det gennemsnitlige beløb, der udbetales i tilfælde af begivenhedstyper, idet der tages højde for de specifikke garantier, som forpligtelserne omfatter. |
| C1270/R3300–R3600 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkrav før risikoreduktion, for hvert af landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1270/R3610 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1270/R3620 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser vedrørende de forskellige lande. |
| C1270/R3630 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | Samlet kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |

| | | |
|--|--|---|
| C1280/R3300–R3600 | Skønnet risikoreduktion | For hvert land den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1280/R3610 | Skønnet risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1290/R3300–R3600 | Skønnede genindsættelsespræmier | For hvert land de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C1290/R3610 | Skønnede genindsættelsespræmier — I alt | De samlede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1300/R3300–R3600 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, vedrørende delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser, for hvert land. |
| C1300/R3610 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande før diversifikation | Samlet kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem landene, for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser. |
| C1300/R3620 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikations-effekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser vedrørende de forskellige lande. |
| C1300/R3630 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Masseulykkesrisici i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for delmodulet for masseulykkesrisici i tilknytning til sygeforsikrings- og sygegenforsikringsforpligtelser under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C1300/R3620. |
| Sygeforsikringskatastroferisici — Ulykkeskoncentration | | |

| | | |
|---|--|--|
| C1310/R3700–R4010 | Største kendte ulykkesrisikokoncentration — Lande | <p>En forsikrings- eller genforsikringskoncerns største ulykkesrisikokoncentration, for hvert land, er lig med det højeste antal personer, for hvilke alle følgende betingelser er opfyldt:</p> <p>Forsikrings- eller genforsikringskoncernen har en arbejdsskadeforsikrings- eller arbejdsskadegenforsikringsforpligtelse eller en gruppeforsikrings- eller -gruppegenforsikringsforpligtelse for indkomstsikring vedrørende de enkelte personer</p> <p>Forpligtelserne vedrørende de enkelte personer dækker mindst én af de i følgende post fastsatte begivenheder</p> <p>Personerne arbejder i den samme bygning, som ligger i dette bestemte land.</p> <p>Disse personer er forsikret mod følgende begivenhedstyper:</p> <p>Dødsfald forårsaget af en ulykke</p> <p>Permanent invaliditet forårsaget af en ulykke</p> <p>Invaliditet, som varer 10 år, forårsaget af en ulykke</p> <p>Invaliditet, som varer 12 måneder, forårsaget af en ulykke</p> <p>Medicinsk behandling i tilknytning til en ulykke.</p> |
| C1320/R3700–R4010, C1330/R3700–R4010, C1350/R3700–R4010, C1360/R3700–R4010 | Gennemsnitlig forsikringssum pr. begivenhedstype | Den gennemsnitlige værdi af ydelser, der skal betales af forsikrings- og genforsikringsselskaber for den største ulykkesrisikokoncentration. |
| C1370/R3700–R4010 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion | Kapitalkravet før risikoreduktion, for hvert land, i tilknytning til delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1410 | Andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen | Angiv ISO-koden for andre lande, der skal indgå i ulykkeskoncentrationen. |
| C1370/R4020 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem lande, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C1370/R4030 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici vedrørende de forskellige lande. |
| C1370/R4040 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion, efter diversifikationseffekten mellem lande, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1380/R3700–R4010 | Skønnet risikoreduktion — Lande | For hvert af de pågældende lande den skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier. |
| C1380/R4020 | Skønnet risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | Den samlede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1390/R3700–R4010 | Skønnede genindsættelsespræmier — Lande | For hvert af de pågældende lande de skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko. |
| C1390/R4020 | Skønnede genindsættelsespræmier — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | De samlede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er for alle lande. |
| C1400/R3700–R4010 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Lande | Kapitalkrav, efter fradrag af den risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici for hvert af de pågældende lande. |
| C1400/R4020 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande før diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion, før diversifikationseffekten mellem lande, for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici. |

| | | |
|---|--|--|
| C1400/R4030 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Diversifikationseffekt mellem lande | Diversifikationseffekt som følge af aggregeringen af kapitalkravet efter risikoreduktion for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici for de forskellige lande. |
| C1400/R4040 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Ulykkeskoncentration i alt — Alle lande efter diversifikation | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion for delmodulet for ulykkeskoncentration vedrørende sygeforsikringsrisici under hensyn til diversifikationseffekten, jf. post C1400/R4020. |
| <i>Sygeforsikringskatastroferisici — Pandemirisici</i> | | |
| C1440/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Antal forsikrede — Lande | Forsikrings- og genforsikringskoncerners antal forsikrede, for hvert af de pågældende lande, som opfylder følgende betingelser: De forsikrede er indbyggere i det pågældende land. De forsikrede er dækket af forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for udgifter til lægebehandling, som ikke er arbejdsskadeforsikrings- eller -genforsikringsforpligtelser, der dækker udgifter til lægebehandling som følge af en smitsom sygdom. Disse forsikrede kan begære ydelser for følgende typer sundhedspleje: Hospitalsindlæggelse Konsultation hos en almenpraktiserende læge Ingen formel lægelig behandling opsøgt. |
| C1450/R4100–R4410, C1470/R4100–R4410, C1490/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Enhedsersatningsudgifter pr. type sundhedspleje — Lande | Bedste skøn over de beløb, beregnet ved hjælp af cash flow-fremskrivning, som forsikrings- og genforsikringskoncerner skal betale for en forsikret vedrørende forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for udgifter til lægebehandling, som ikke er arbejdsskadeforsikrings- eller -genforsikringsforpligtelser, pr. type benyttelse af sundhedspleje, i tilfælde af en pandemi, for hvert af de pågældende lande. |
| C1460/R4100–R4410, C1480/R4100–R4410, C1500/R4100–R4410 | Udgifter til lægebehandling — Andelen af forsikrede pr. type sundhedspleje — Lande | Andelen af forsikrede med kliniske symptomer, der bruger type sundhedspleje, for hvert af de pågældende lande. |

| | | |
|-------------------|--|--|
| C1510/R4100–R4410 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Lande | Kapitalkravet før risikoreduktion, for hvert af de pågældende lande, i tilknytning til delmodul for pandemi vedrørende sygeforsikringsrisici. |
| C1550 | Andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici | Angiv ISO-koden for andre lande, der skal tages i betragtning i relation til pandemirisici. |
| C1420/R4420 | Indkomstsikring — Antal forsikrede — Pandemirisici i alt for alle lande | Samlet antal forsikrede for alle de pågældende lande, som er dækket af andre forsikrings- eller genforsikringsforpligtelser for indkomstsikring end arbejdsskade- eller arbejdsskade-genforsikringsforpligtelser. |
| C1430/R4420 | Indkomstsikring — Samlet eksponering vedrørende pandemirisici — Pandemirisici i alt for alle lande | Forsikrings- og genforsikringskoncerners samlede eksponering vedrørende indkomstsikring i tilknytning til pandemirisici for alle de pågældende lande. Værdi af ydelserne, der skal betales for den forsikrede, er forsikringssummen eller, hvis forsikringsaftalen omfatter tilbagevendende ydelsesbetalinger, det bedste skøn over ydelsesbetalingerne, idet det antages, at den sikrede er permanent invalideret og ikke vil komme sig. |
| C1510/R4420 | Kapitalkrav for katastroferisici før risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Det samlede kapitalkrav før risikoreduktion i tilknytning til delmodul for pandemirisici vedrørende sygeforsikringsrisici for alle de pågældende lande. |
| C1520/R4420 | Skønnet risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Den samlede skønnede risikoreducerende virkning af koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er i tilknytning til denne risiko, eksklusive de skønnede genindsættelsespræmier, for alle de pågældende lande. |
| C1530/R4420 | Skønnede genindsættelsespræmier — Pandemirisici i alt for alle lande | De samlede skønnede genindsættelsespræmier i tilknytning til koncernens specifikke genforsikringsaftaler og SPV'er vedrørende denne risiko for alle de pågældende lande. |
| C1540/R4420 | Kapitalkrav for katastroferisici efter risikoreduktion — Pandemirisici i alt for alle lande | Det samlede kapitalkrav efter risikoreduktion i tilknytning til delmodul for pandemirisici vedrørende sygeforsikringsrisici for alle de pågældende lande. |

S.31.01 — Genforsikringsandel (herunder finite reinsurance og SPV'er)

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema udfyldes af forsikrings- og genforsikringskoncernerne i tilfælde, hvor beløb, der kan tilbagekræves, indregnes af tilknyttede forsikringsselskaber i relation til EØS- eller ikke-EØS-genforsikringsselskaber, som ikke hører ind under koncernens anvendelsesområde (selv hvis alle aftaler med det pågældende genforsikringsselskab er ophørt).

Med skemaet indsamles der oplysninger om genforsikringselskaber og ikke om særskilte aftaler. Samtlige cederede forsikringsmæssige hensættelser, inklusive hensættelser cederet i henhold til Finite reinsurance (som defineret i S.30.03 under C0060 i bilag II), skal være afsluttet. Hvis en SPV eller et Lloyd's-syndikat fungerer som genforsikringselskab, skal SPV'et og syndikatet også opregnes.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0010 | Registreret navn på genforsikret selskab | Navnet på den genforsikrede enhed, med angivelse af det cederende (gen)forsikringselskab. Denne post er kun relevant for koncerner. |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | Selskabets identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Hvis selskabet anvender muligheden »Specifik kode«, skal følgende tages i betragtning: <ul style="list-style-type: none"> — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal den konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for selskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Genforsikringselskabets kode | Identifikationskode for genforsikringselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge): <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. |
| C0050 | Genforsikringselskabets kodetype | Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes: <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0060 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Præmiehensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder ikke-SLT-sygeforsikring | Genforsikringselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for præmiehensættelser, beregnet som nutidsværdien af de forventede fremtidige ind- og udgående cash flow. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0070 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Erstatningshensættelser vedrørende skadesforsikring, herunder ikke-SLT-sygeforsikring | Genforsikringsselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for erstatningshensættelser. |
| C0080 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler — Forsikringsmæssige hensættelser vedrørende livsforsikring, herunder SLT-sygeforsikring | Genforsikringsselskabets andel af det beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler (herunder Finite Re og SPV), før justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse, i det bedste skøn for forsikringsmæssige hensættelser. |
| C0090 | Justering for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse | Justering pr. genforsikringsselskab for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. Justeringen beregnes særskilt og skal være i overensstemmelse med delegeret forordning (EU) 2015/35. Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi. |
| C0100 | Beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | Resultatet af cederede forsikringsmæssige hensættelser (dvs. erstatnings- + præmiehensættelser), herunder justeringen for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse. |
| C0110 | Nettotilgodehavender | Forfaldne beløb, der stammer fra: erstatninger udbetalt af forsikringsselskabet, men som endnu ikke er refunderet af genforsikringsselskabet, plus provision, som skal betales af genforsikringsselskabet, og andre tilgodehavender minus gæld til genforsikringsselskabet. Kontante indskud medregnes ikke og skal betragtes som modtagne garantier. |
| C0120 | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskabet | Aktiver stillet som sikkerhed af genforsikringsselskabet for at reducere genforsikringsselskabets modpartsrisiko. |
| C0130 | Finansielle garantier | Garantier modtaget af selskabet fra genforsikringsselskabet for at garantere betaling af selskabets forpligtelser (omfatter rembuser, uudnyttede lånefaciliteter). |
| C0140 | Kontante indskud | Kontante indskud, som selskabet har modtaget fra genforsikringsselskaberne. |
| C0150 | Samlede modtagne garantier | Det samlede beløb af de forskellige typer garantier. Svarer til summen af de i C0120, C0130 og C0140 indberettede værdier. |
| C0155 | Valuta | Angiv i givet fald ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for genforsikringsbeløb, der kan tilbagekræves. Opdeling efter valuta kræves kun for at dække 90 % af beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. For de resterende 10 % er det muligt at samle disse under »andre valutaer«. |
| | Oplysninger om genforsikringsselskaber | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0160 | Genforsikringsselskabets kode | <p>Identifikationskode for genforsikringsselskabet ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode tildelt af selskabet. |
| C0170 | Kodetype kodetype | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Genforsikringsselskabets kode«. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0180 | Genforsikringsselskabets registrerede navn | <p>Det registrerede navn på det genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til. Det officielle navn på det risikobærende genforsikringsselskab er angivet i genforsikringsaftalen. Det er ikke tilladt at angive navnet på en genforsikringsmægler. Det er heller ikke tilladt at angive en generel betegnelse eller et ufuldstændigt navn, da internationale genforsikringsselskaber har flere driftsselskaber, som kan være baseret i forskellige lande.</p> <p>I tilfælde af puljeaftaler er det kun tilladt at angive navnet på puljen (eller puljeforvalteren), hvis puljen er en juridisk person.</p> |
| C0190 | Genforsikringsselskabets type | <p>Den type genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Direkte livsforsikringsselskab 2 — Direkte skadesforsikringsselskab 3 — Direkte forsikringsselskab, som tegner flere forsikringsklasser 4 — Captive-forsikringsselskab 5 — Internt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som først og fremmest fokuserer på at overtage risici fra andre forsikringsselskaber, der er omfattet af koncerntilsyn) 6 — Eksternt genforsikringsselskab (genforsikringsselskab, som overtager risici fra andre selskaber end forsikringsselskaber, der er omfattet af koncerntilsyn) 7 — Captive-genforsikringsselskab 8 — Special purpose vehicles (SPV'er) 9 — Puljeenhed (hvor mere end et enkelt forsikrings- eller genforsikringsselskab er involveret) 10 — Offentlig pulje |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0200 | Hjemland | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor genforsikringsselskabet er meddelt tilladelse/licens. |
| C0210 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>Den faktiske/aktuelle vurdering, som indgår i koncernens overvejelser.</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes posten ikke, og genforsikringsselskabet identificeres som »9 — Der foreligger ingen vurdering« i kolonne C0230 (kreditkvalitetstrin).</p> <p>Denne post er ikke relevant for genforsikringsselskaber, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>Hvis der indberettes »Mange ECAI'er« i C0220, indberettes den mest repræsentative eksterne vurdering.</p> |
| C0220 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0210, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> <p>—</p> |
| C0230 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt genforsikringsselskabet. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af de koncerner, der anvender standardformlen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> <p>2 — Kreditkvalitetstrin 2</p> <p>3 — Kreditkvalitetstrin 3</p> <p>4 — Kreditkvalitetstrin 4</p> <p>5 — Kreditkvalitetstrin 5</p> <p>6 — Kreditkvalitetstrin 6</p> <p>9 — Der foreligger ingen vurdering.</p> |
| C0240 | Intern vurdering | <p>Intern vurdering af genforsikringsselskabet for koncerner, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modeller. Hvis et selskab, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke.</p> |

S.31.02 — Special Purpose Vehicles

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema er relevant for alle koncerner, der overfører risici til en special purpose vehicle (SPV), og det har til formål at sikre, at der gives tilstrækkelige oplysninger om SPV'er, der anvendes som et alternativ til almindelige genforsikringsaftaler til at overføre risici.

Skemaet skal anvendes til:

- a) SPV'er, der er defineret i artikel 13, nr. 26), og meddelt tilladelse i artikel 211, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF
- b) SPV'er, der opfylder betingelserne i artikel 211, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF
- c) SPV'er, der reguleres af tredjelandes tilsynsmyndigheder, hvis disse træffer foranstaltninger, som svarer til betingelserne i artikel 211, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF
- d) Andre SPV'er, der ikke er defineret som ovenfor, hvis risici overføres i henhold til aftaler af samme økonomiske substans som en genforsikringsaftale.

Skemaet vedrører de risikoreduktionsmetoder (uanset om de er indregnet), som det (gen)forsikringsselskab, der er omfattet af koncerntilsyn, anvender, og som indebærer, at en SPV overtager risici fra det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, i henhold til en genforsikringsaftale eller overtager forsikringsrisici fra det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, og som er overført gennem en lignende ordning af »genforsikringstypen«.

Dette skema skal indeholde data om special purpose vehicles, som det deltagende forsikrings- eller genforsikringsselskab eller et af dets forsikrings- eller genforsikringsdatterselskaber har overdraget risici til.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0010 | Navn på genforsikrings-selskab | Det registrerede navn på det genforsikrede selskab, med angivelse af det cederende (gen) forsikringsselskab, som er omfattet af koncerntilsyn. |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0030 | SPV's interne kode | <p>Intern kode, som tildeles SPV'et af selskabet i denne rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode <p>Denne kode er unik for den enkelte SPV og forbliver konstant i efterfølgende indberetninger.</p> |
| C0040 | ID-kode for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | <p>For værdipapirer og andre finansieringsmekanismer, der er udstedt af SPV'er, og som besiddes af det forsikrings- eller genforsikringsselskab, der er omfattet af koncerntilsyn, angives en eventuel ID-kode i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-koden ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre »anerkendte« koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — kode, der tildeles af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid |
| C0050 | ID-kodetype for værdipapirer og andre finansieringsmekanismer udstedt af SPV'er | <p>ID-kodetype anvendt under »Aktiv-ID-kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn |
| C0060 | Brancher med relation til SPV-securitisering | <p>Navn på den indberettede branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring |

| | POST | VEJLEDNING |
|--|------|--|
| | | 9 — Kredit- og kautionsforsikring |
| | | 10 — Retshjælpsforsikring |
| | | 11 — Assistance |
| | | 12 — Diverse økonomiske tab |
| | | 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling |
| | | 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring |
| | | 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring |
| | | 16 — Proportional motoransvarsgenforsikring |
| | | 17 — Proportional anden motorgenforsikring |
| | | 18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring |
| | | 19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom |
| | | 20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring |
| | | 21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring |
| | | 22 — Proportional retshjælpsegensforsikring |
| | | 23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance |
| | | 24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab |
| | | 25 — Ikkeproportional sygegensforsikring |
| | | 26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring |
| | | 27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring. |
| | | 28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring. |
| | | 29 — Sygeforsikring |
| | | 30 — Forsikring med gevinstandele |
| | | 31 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring |
| | | 32 — Anden livsforsikring |
| | | 33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser |
| | | 34 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| | | <p>35 — Sygegenforsikring</p> <p>36 — Livs-genforsikring.</p> <p>37 — Flere brancher (som defineret herunder)</p> <p>Hvis genforsikringsaftalen eller en lignende aftale tilvejebringer dækning for mere end en enkelt branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, og forsikringsvilkårene er forskellige brancherne imellem, skal aftalen beskrives på flere rækker. På den første række indsættes udtrykket »Flere brancher«, og der gives en nærmere beskrivelse af aftalens overordnede vilkår, mens der på de efterfølgende rækker gives der en nærmere beskrivelse af genforsikringsaftalens individuelle vilkår for hver af de relevante brancher. Hvis forsikringsvilkårene ikke er forskellige brancherne imellem, angives kun den væsentligste branche.</p> |
| C0070 | Udløsende faktor(er) i SPV'et | <p>Angiv de udløsende mekanismer, som SPV'et anvender som udløsende begivenheder, der forpligter SPV'et til at foretage udbetalinger til det cederende (gen)forsikringsselskab, der er omfattet af koncerntilsyn. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Erstatning</p> <p>2 — Tab fra modellen</p> <p>3 — Indeks eller parametre</p> <p>4 — Kombinationer (omfatter dele af ovennævnte mekanismer)</p> <p>5 — Andet</p> |
| C0080 | Aftalerelateret udløsende begivenhed | <p>Angiv den særlige udløsende begivenhed, der forpligter SPV'et til at foretage udbetalinger til det cederende (gen)forsikringsselskab, der er omfattet af koncerntilsyn. Denne oplysning bør supplere oplysningen under »Type udløsende mekanisme(r) i SPV« og bør være tilstrækkeligt beskrivende til, at tilsynsmyndigheden kan identificere den konkrete udløsende begivenhed, f.eks. særlige vejr- eller stormrelaterede indekser for katastroferisici eller almindelige dødelighedstabeller for levetidsrisici.</p> |
| C0090 | Samme udløsende begivenhed som i underliggende cedents portefølje? | <p>Angiv, om den udløsende begivenhed, der er defineret i den underliggende (gen)forsikringspolice med den udløsende begivenhed for udbetaling, der er defineret i aftalen, er den samme som den udløsende begivenhed, der er defineret i SPV'et. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Samme udløsende begivenhed</p> <p>2 — Anden udløsende begivenhed</p> |
| C0100 | Basisrisiko som følge af risikooverførsels opbygning | <p>Angiv årsagerne til basisrisikoen (dvs. at den eksponering, der er omfattet af risikoreduktionsteknikken, ikke svarer til risikoeksponeringen for det forsikrings- eller genforsikringsselskab, der er omfattet af koncerntilsyn). Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Ingen basisrisiko</p> <p>2 — Utilstrækkelig efterstilling for værdipapirindehavere</p> <p>3 — Investorers mulighed for at gøre yderligere krav gældende over for cedent</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| | | <p>4 — Yderligere risici securitiseret efter meddelelse af tilladelse</p> <p>5 — Cedenter eksponeret mod udstedte værdipapirer</p> <p>9 — Andet</p> |
| C0110 | Basisrisiko som følge af aftalevilkår | <p>Angiv den basisrisiko, der opstår som følge af aftalevilkår.</p> <p>1 — Ingen basisrisiko</p> <p>2 — Væsentlig del af forsikrede risici ikke overført</p> <p>3 — Udløsende begivenhed ikke tilstrækkelig til at matche cedentens risikoeksponering</p> |
| C0120 | SPV-aktiver specifikt afgrænset (ring-fenced) til at indfri cedentspecifikke forpligtelser | SPV-aktiver, som er specifikt afgrænsede (ring-fenced) til den indberettende cedent, og som kan anvendes til at indfri de aftalerelaterede forpligtelser, som SPV'et har genforsikret udelukkende for den pågældende specifikke cedent (aktiver stillet som sikkerhed og specifik indregnet i SPV'ets balance i forhold til den påtagne forpligtelse). |
| C0130 | Andre ikkecedentspecifikke SPV-aktiver med eventuel mulighed for at gøre krav | SPV-aktiver (indregnet i SPV'ets balance), som ikke er direkte knyttet til den indberettende cedent, men med mulighed for at gøre krav. De omfatter SPV'ets »frie aktiver«, som eventuelt kan anvendes til at indfri den indberettende cedents forpligtelser. |
| C0140 | Andre muligheder for at gøre krav som følge af securitisering | SPV'ets eventualaktiver (ikkebalanceførte), som ikke er direkte knyttet til den indberettende cedent, men med mulighed for at gøre krav. Det omfatter krav mod andre af SPV'ets modparter, herunder garantier, genforsikringsaftaler og derivatforpligtelser over for SPV'et indgået af SPV'ets eksponeringsleverende institut, værdipapirindehavere eller andre tredjeparter. |
| C0150 | Størst mulige antal samlede forpligtelser fra SPV's side i henhold til genforsikringspolice | Størst mulige antal samlede forpligtelser som følge af genforsikringsaftalen (cedentspecifik). |
| C0160 | SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser i hele indberetningsperioden | <p>Angiv, om afdækningen fra risikoreduktionsteknikken kun kan anerkendes delvist, hvis modparten til en genforsikringsaftale ikke længere kan tilvejebringe effektiv og fortløbende risikooverførsel. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — SPV fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser</p> <p>2 — SPV ikke fuldt finansieret i forhold til cedents forpligtelser</p> |
| C0170 | Aktuelle beløb, som kan tilbagekræves fra SPV | SPV-relaterede beløb, som kan tilbagekræves, og som indregnes i Solvens II-balancen for det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn (før justeringer for forventede tab som følge af modpartens misligholdelse). De bør beregnes i overensstemmelse med kravene i artikel 41 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |

| | POST | VEJLEDNING |
|--------------------|---|--|
| C0180 | Væsentlige investeringer, som cedent besidder i SPV | <p>Angiv, om cedenten besidder væsentlige investeringer i SPV'et, jf. artikel 210 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>1 — Ikke relevant</p> <p>2 — Investeringer, foretaget af SPV'et, som cedenten og/eller det eksponeringsleverende institut (hvis det ikke svarer til cedenten) disponerer over</p> <p>3 — Investeringer, foretaget af SPV'et, som besiddes af cedenten (SPV'ets egenkapital, værdipapirer eller anden efterstillet gæld)</p> <p>4 — Cedenten sælger genforsikring eller anden risikoreduktionsafdækning til SPV'et</p> <p>5 — Cedenten har tilvejebragt SPV'et eller værdipapirindehavere garanti eller anden kreditforbedring</p> <p>6 — Cedenten tilbageholder tilstrækkelig basisrisiko</p> <p>9 — Andet.</p> <p>Ved eventuel indberetning skal instrumentet angives i celle C0030 og C0040.</p> |
| C0190 | Securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut | <p>Angiv, om der findes securitiseringsaktiver med tilknytning til cedent forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut, jf. bestemmelserne i artikel 214, stk. 2, og artikel 326 i delegeret forordning (EU) 2015/35. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut</p> <p>2 — Ikke forvaltet af anden tredjepart end cedent/organiserende institut</p> |
| Oplysninger om SPV | | |
| C0200 | SPV's interne kode | <p>Intern kode, som er tildelt SPV'et af det selskab, der er omfattet af koncerntilsyn, efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <p>— LEI-kode (Legal Entity Identifier)</p> <p>— Specifik kode</p> <p>Specifik kode:</p> <p>— For EØS-forsikrings- og genforsikrings-selskaber og andre EØS-regulerede selskaber, der er omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|----------------------------|---|
| | | <p>— for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format:</p> <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> <p>Denne kode er unik for den enkelte SPV og forbliver konstant i efterfølgende indberetninger.</p> |
| C0210 | Kodetype for SPV | <p>Angiv den kode, som anvendes under »SPV's interne kode«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0220 | SPV's juridiske karakter | <p>Angiv SPV-securitiseringens juridiske karakter, jf. artikel 13, nr. 26), i direktiv 2009/138/EF.</p> <p>Udtømmende liste</p> <p>1 — Truster</p> <p>2 — Partnerskaber</p> <p>3 — Selskaber med begrænset ansvar</p> <p>4 — Andre former for juridiske personer end ovennævnte</p> <p>5 — Ikke etableret som juridisk person</p> |
| C0230 | SPV's navn | Angiv SPV'ets navn |
| C0240 | SPV's registreringsnr. | Registreringsnummer modtaget ved etablering af SPV'et som juridisk person. For SPV'er, der ikke er etableret som juridisk person, indberetter koncernen det identifikationsnummer eller tilsvarende nummer, som modtages fra tilsynsmyndigheden på godkendelsestidspunktet. |
| C0250 | Land, hvor SPV er godkendt | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor SPV'et er etableret og godkendt, hvis det er relevant. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0260 | Betingelser for godkendelse af SPV | <p>Angiv betingelserne for godkendelse af SPV'et i henhold til artikel 211 i direktiv 2009/138/EF eller tilsvarende bestemmelse i retsakt. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — SPV godkendt i henhold til artikel 211, stk. 1, i direktiv 2009/138/EF</p> <p>2 — SPV godkendt i henhold til artikel 211, stk. 3, i direktiv 2009/138/EF (omfattet af overgangsbestemmelser)</p> <p>3 — SPV reguleret af tilsynsmyndighed i et tredjeland, hvor SPV'et opfylder krav, som svarer til kravene i artikel 211, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF</p> <p>4 — SPV ikke omfattet af ovenstående</p> |
| C0270 | Ekstern kreditvurdering fra udpeget ECAI | <p>(Eventuel) vurdering af SPV'et, som selskabet tager højde for, og som er udstedt af et eksternt kreditvurderingsinstitut.</p> <p>Hvis vurderingen ikke foreligger, udfyldes posten ikke, og SPV'et identificeres som »9 — Der foreligger ingen vurdering« i kolonne C0290 (kreditkvalitetstrin).</p> <p>Denne post er ikke relevant for SPV'er, for hvilke de selskaber, der anvender intern model, anvender interne vurderinger. Hvis selskaber, der anvender intern model, ikke anvender interne vurderinger, skal denne post indberettes.</p> <p>Hvis der indberettes »Mange ECAI'er« i C0280, indberettes den mest repræsentative eksterne vurdering.</p> |
| C0280 | Udpeget ECAI | <p>Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der afgiver den eksterne vurdering i C0270, ved hjælp af navnet på ECAI'et som offentliggjort på ESMA's websted. Hvis der er tale om vurderinger fra ECAI'ets datterselskaber, indberettes moder-ECAI'et (der henvises til ESMA's liste over kreditvurderingsbureauer, der er registreret eller godkendt i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer).</p> |
| C0290 | Kreditkvalitetstrin | <p>Angiv det kreditkvalitetstrin, der er tildelt SPV'et. Kreditkvalitetstrinnet skal afspejle alle de justeringer af kreditkvaliteten, der er foretaget internt af koncernen.</p> <p>En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>0 — Kreditkvalitetstrin 0</p> <p>1 — Kreditkvalitetstrin 1</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------------------|---|
| | | 2 — Kreditkvalitetstrin 2 3 — Kreditkvalitetstrin 3 4 — Kreditkvalitetstrin 4 5 — Kreditkvalitetstrin 5 6 — Kreditkvalitetstrin 6 9 — Der foreligger ingen vurdering. |
| C0300 | Intern vurdering | Intern vurdering af SPV'et for koncerner, der anvender interne modeller, forudsat at de interne vurderinger anvendes i deres interne modeller. Hvis en koncern, der bruger en intern model, udelukkende anvender eksterne vurderinger, indberettes denne post ikke. |

S.32.01 — Selskaber, der indgår i koncernen

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den indledende og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema anvendes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, eller når der anvendes en kombination af metoder. Det er en liste over alle selskaber i koncernen, jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF, som er underlagt et fuldt koncerntilsyn i henhold til artikel 213, stk. 2, litra a), b) og c), i direktiv 2009/138/EF, inklusive de deltagende forsikrings- og genforsikrings-selskaber, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber i toppen af koncernen.

- Celle C0010-C0080 vedrører identifikation af selskabet
- Celle C0090-C0170 vedrører prioriteringskriterier (i koncernens indberetningsvaluta)
- Celle C0180-C0230 vedrører indflydelseskriterier
- Celle C0240 og C0250 vedrører spørgsmålet om koncerntilsyn eller ej for selskabet
- Celle C0260 vedrører beregning af koncernsolvens.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|------|---|
| C0010 | Land | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, hvor det vedtægtsmæssige hjemsted for hvert selskab i koncernen, jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF, er beliggende. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen, jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikke regulerede selskaber inden for koncernen, jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF, tildeles identifikationskoden af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Identifikationskode for selskabet«:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Registreret navn på selskab | Registreret navn på selskab |
| C0050 | Type selskab | <p>Angiv selskabets type ved at oplyse, hvilke aktiviteter selskabet udøver. Gælder både EØS-selskaber og selskaber i tredjelande. Selskabstypen er knyttet til, hvordan selskaberne indgår i beregningen af koncernsolvensen som indberettet i C0260 i dette skema. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Livsforsikringsselskab 2 — Skadesforsikringsselskab 3 — Genforsikringsselskab 4 — Forsikringsselskab, der tegner flere forsikringsklasser 5 — Forsikringsholdingselskab som defineret i artikel 212, stk. 1, litra f), i direktiv 2009/138/EF. 6 — Blandet forsikringsholdingselskab som defineret i artikel 212, stk. 1, litra g), i direktiv 2009/138/EF 7 — Blandet finansielt holdingselskab som defineret i artikel 212, stk. 1, litra h), i direktiv 2009/138/EF |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|-------------------------------------|--|
| | | <p>8 — Kreditinstitut, investeringselskab eller finansieringsinstitut</p> <p>9 — Arbejdsmarkedsrelateret pensionskasse</p> <p>10 — Accessorisk servicevirksomhed som defineret i artikel 1, nr. 53), i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>11 — Ikkereguleret selskab, der udøver finansielle aktiviteter, som defineret i artikel 1, nr. 52), i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>12 — Special purpose vehicle godkendt i henhold til artikel 211 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>13 — Special purpose vehicle, der ikke er et special purpose vehicle godkendt i henhold til artikel 211 i direktiv 2009/138/EF</p> <p>14 — UCITS-administrationsselskab som defineret i artikel 1, nr. 54), i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>15 — Forvalter af alternativ investeringsfond som defineret i artikel 1, nr. 55, i delegeret forordning (EU) 2015/35</p> <p>99 — Andet</p> |
| C0060 | Selskabsform | <p>Angiv selskabsformen.</p> <p>For så vidt angår kategori 1-4 i cellen »Type selskab« skal selskabsformen være i overensstemmelse med bilag III til direktiv 2009/138/EF.</p> |
| C0070 | Kategori (gensidigt/ikke-gensidigt) | <p>Angiv overordnede oplysninger om selskabsformen, dvs. om selskabet er et gensidigt selskab eller ej.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Gensidigt</p> <p>2 — Ikkegensidigt</p> |
| C0080 | Tilsynsmyndighed | <p>Navnet på den tilsynsmyndighed, der er ansvarlig for tilsynet med det enkelte selskab, hvor det er relevant.</p> <p>Angiv myndighedens fulde navn.</p> |
| Prioriteringskriterier (i koncernens indberetningsvaluta) | | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0090 | Samlet balancesum (for (gen)forsikringselskaber) | For EØS-(gen)forsikringselskaber, samlet balancesum i henhold til Solvens II som indberettet under C0010/R0500 i S.02.01. For ikke-EØS-(gen)forsikringselskaber, samlet balancesum i henhold til de relevante sektorbestemte regler. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0100 | Samlet balancesum (for andre regulerede selskaber) | For andre regulerede selskaber, samlet balancesum i henhold til de relevante sektorbestemte regler. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0110 | Samlet balancesum (for ikkeregulerede selskaber) | For ikkeregulerede selskaber, samlet balancesum i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0120 | Tegnede præmier med fradrag af genforsikring cederet i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP for (gen)forsikringselskaber | For forsikrings- og genforsikringselskaber, tegnede præmier med fradrag af genforsikring cederet i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0130 | Omsætning defineret som bruttoindtægter i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP for andre selskabstyper, for forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber. | For andre typer selskaber, omsætning defineret som bruttoindtægter i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP. For forsikringsholdingselskaber eller blandede finansielle holdingselskaber, anvendes, hvis det er relevant, omsætning defineret som bruttoindtægter i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP som et prioriteringskriterium. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0140 | Forsikringsresultater | (Gen)forsikringselskaber indberetter deres forsikringsresultater i overensstemmelse med deres regnskab. Der indberettes et pengebeløb. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |
| C0150 | Investeringsresultater | (Gen)forsikringselskaber indberetter deres investeringsresultater i overensstemmelse med deres regnskab. Der indberettes et pengebeløb. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. I beløbet medregnes ikke beløb, som allerede er indberettet under C0140. |
| C0160 | Samlede resultater | Alle de tilknyttede selskaber, som er omfattet af koncerntilsyn, jf. artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF, indberetter deres samlede resultater i overensstemmelse med deres regnskab. Der indberettes et pengebeløb. Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta. |

| | POST | VEJLEDNING |
|------------------------------|---|--|
| C0170 | Regnskabsstandard | <p>Angiv, hvilken regnskabsstandard der anvendes til indberetningen af poster i celle C0100-C0160. Alle poster indberettes konsekvent i overensstemmelse med den samme regnskabsstandard. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <p>1 — IFRS</p> <p>2 — Lokale GAAP</p> |
| <i>Indflydelseskriterier</i> | | |
| C0180 | Kapitalandel i % | <p>Den del af den tegnede kapital, som det deltagende selskab direkte eller indirekte besidder i det tilknyttede selskab (jf. artikel 221 i direktiv 2009/138/EF).</p> <p>Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab.</p> |
| C0190 | % anvendt ved opstillingen af de konsoliderede regnskaber | <p>Procentandel som defineret i overensstemmelse med IFRS eller lokale GAAP, der anvendes til at integrere konsoliderede selskaber i konsolideringen, og som kan være forskellig fra C0180. Ved fuldstændig integration indberettes minoritetsinteresser også under denne post.</p> <p>Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab.</p> |
| C0200 | % stemmerettigheder | <p>Den del af stemmerettighederne, som det deltagende selskab direkte eller indirekte besidder i det tilknyttede selskab.</p> <p>Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab.</p> |
| C0210 | Andre kriterier | <p>Andre kriterier, som kan anvendes til at vurdere, i hvilket omfang det deltagende selskab udøver indflydelse, f.eks. forhold som omhandlet i artikel 22, stk. 7, i direktiv 2013/34/EU, centraliseret risikostyring.</p> <p>Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab.</p> |
| C0220 | Indflydelse | <p>Der kan enten udøves bestemmende eller betydelig indflydelse, afhængigt af tidligere omtalte kriterier. Det er koncernen, der skal vurdere, hvilken grad af indflydelse det deltagende selskab udøver over et andet selskab, men som omhandlet i artikel 212, stk. 2, i direktiv 2009/138/EF kan den koncerntilsynsførende have en opfattelse, der afviger fra koncernens vurdering, og i så fald skal koncernen tage hensyn til den afgørelse, der er truffet af den koncerntilsynsførende.</p> <p>Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Bestemmende</p> <p>2 — Betydelig.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0230 | Forholdsmæssig andel anvendt til beregning af koncernsolvensen | Den forholdsmæssige andel er den andel, der vil blive anvendt til at beregne koncernsolvensen. Denne celle udfyldes ikke for det øverste moderselskab. |
| | <i>Omfattet af koncern-tilsyn</i> | |
| C0240 | Omfattet af anvendelsesområdet for koncerntilsyn — Ja/Nej | Angiv, om selskabet er omfattet af koncerntilsyn eller ej, jf. artikel 214 i direktiv 2009/138/EF. Hvis selskabet ikke er omfattet af koncerntilsyn i henhold til artikel 214, skal det angives, hvilket afsnit i artikel 214, stk. 2, dette skyldes. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Omfattet af anvendelsesområdet 2 — Ikke omfattet af anvendelsesområdet (artikel 214, litra a) 3 — Ikke omfattet af anvendelsesområdet (artikel 214, litra b) 4 — Ikke omfattet af anvendelsesområdet (artikel 214, litra c). |
| C0250 | Omfattet af anvendelsesområdet for koncerntilsyn — Dato for afgørelsen, hvis artikel 214 finder anvendelse | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor afgørelsen om, at selskabet ikke er omfattet af koncerntilsyn, blev truffet. |
| | <i>Beregning af koncernsolvens</i> | |
| C0260 | Anvendt metode og for så vidt angår metode 1 behandling af selskabet | Denne post vedrører oplysninger om, hvilken metode der anvendes til beregning af koncernsolvensen, og behandlingen af hvert selskab. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Metode 1: Fuld konsolidering 2 — Metode 1: Pro rata-konsolidering 3 — Metode 1: Den justerede indre værdis metode 4 — Metode 1: Sektorregler 5 — Metode 2: Solvens II 6 — Metode 2: Sektorbestemte regler 7 — Metode 2: Lokale regler 8 — Fradrag af kapitalinteressen i henhold til artikel 229 i direktiv 2009/138/EF 9 — Ikke omfattet af anvendelsesområdet for koncerntilsyn, jf. artikel 214 i direktiv 2009/138/EF 10 — Anden metode. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0270 | Omfattet af den interne model for beregninger af solvenskapitalkrav på koncernniveau | 1 — Ja 2 — Nej |
| C0280 | Type volatilitetsjustering, der er anvendt i den koncerninterne model | Type volatilitetsjustering, der er anvendt til beregninger af koncernsolvensen af selskaber, der er omfattet af den koncerninterne model Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Ingen 2 — Konstant volatilitetsjustering 3 — Dynamisk volatilitetsjustering Hvis en intern model anvendes uden volatilitetsjustering, eller standardformlen anvendes til beregning af koncernsolvensen, vælges »Ingen«. |

S.33.01 — Individuelle krav for forsikrings- og genforsikringsselskaber

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den indledende og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema anvendes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, eller når der anvendes en kombination af metoder på følgende måde:

- I den første del (celle C0060-C0230) indsamles der oplysninger om alle forsikrings- og genforsikringsselskaber i koncernen fra EØS-lande og ikke-EØS-lande, der anvender direktiv 2009/138/EF i overensstemmelse med de deri fastsatte regler, uanset den metode, der er anvendt til beregning af koncernsolvensen.
- I den anden del (celle C0240-C0260) indsamles der oplysninger om de lokale kapitalkrav, de lokale minimumskapitalkrav og det anerkendte kapitalgrundlag for alle ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringsselskaber i koncernen, der skal indberettes i overensstemmelse med lokale regler, uanset hvilken metode der anvendes til beregning af koncernsolvensen.
- Sidste celle C0270 indeholder oplysninger om bidraget fra det enkelte selskab til solvenskapitalkravet på koncernniveau for alle forsikrings- og genforsikringsselskaber i og uden for EØS.
- Formålet med data i dette skema er at give de tilsynsførende oplysninger, som forbedrer vurderingen af det til rådighed stående kapitalgrundlag og letter vurderingen af beløbet for diversifikationseffekter.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0010 | Registreret navn på selskab | Registreret navn på hvert selskab |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskabets kode | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Identifikationskode for selskabet«:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Enhedsniveau/Ring-fenced fond eller matchtilpasningsportefølje/Resterende del | <p>Angiv, hvad oplysningerne vedrører. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Enhedsniveau 2 — Ring-fenced fond eller matchtilpasningsportefølje 3 — Resterende del |
| C0050 | Fondsnummer | <p>Når C0040 = 2, er fondsnummeret det unikke nummer for hver væsentlig ring-fenced fond eller matchtilpasningsportefølje som tildelt af koncernen. Det skal forblive uændret over tid. Det må ikke genanvendes til andre fonde eller porteføljer. Nummeret skal anvendes konsistent i alle skemaer, hvor det er relevant, til at angive den pågældende fond/portefølje.</p> <p>Når C0040 = 1 eller 3, indberettes »0«.</p> |
| | <i>EØS- og ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringselskaber (som anvender Solvens II-regler)</i> | |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0060 | Solvenskapitalkrav for markedsrisici | Individuelt solvenskapitalkrav for markedsrisici (brutto) for hvert selskab. |
| C0070 | Solvenskapitalkrav for modpartsrisici | Individuelt solvenskapitalkrav for modpartsrisici (brutto) for hvert selskab. |
| C0080 | Solvenskapitalkrav for livsforsikringsrisici | Individuelt solvenskapitalkrav for livsforsikringsrisici (brutto) for hvert selskab. |
| C0090 | Solvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici | Individuelt solvenskapitalkrav for sygeforsikringsrisici (brutto) for hvert selskab. |
| C0100 | Solvenskapitalkrav for skadesforsikringsrisici | Individuelt solvenskapitalkrav for skadesforsikringsrisici (brutto) for hvert selskab. |
| C0110 | Solvenskapitalkrav for operationelle risici | Individuelt solvenskapitalkrav for operationelle risici (brutto) for hvert selskab. |
| C0120 | Individuelt solvenskapitalkrav | Individuelt solvenskapitalkrav for hvert selskab (inklusive et eventuelt kapitaltillæg). |
| C0130 | Individuelt minimumskapitalkrav | Individuelt minimumskapitalkrav for hvert selskab. |
| C0140 | Anerkendt individuelt kapitalgrundlag til dækning af teoretisk kapitalkrav | Anerkendt individuelt kapitalgrundlag til dækning af teoretisk kapitalkrav. Det samlede kapitalgrundlag skal indberettes under denne post. Ingen restriktioner vedrørende elementer, som ikke står til rådighed for koncernen. |
| C0150 | Anvendelse af selskabsspecifikke parametre | Når et selskab anvender selskabsspecifikke parametre til beregning af det individuelle teoretiske solvenskapitalkrav, indberettes det, inden for hvilket eller hvilke områder disse parametre anvendes. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Livsforsikringsrisici/genoptagelsesrisici 2 — SLT-sygeforsikringsrisici/genoptagelsesrisici 3 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for NSLT-sygeforsikringer 4 — Præmie- og erstatningshensættelsesrisici for skadesforsikringer Angiv så mange optioner, som det er nødvendigt, adskilt med et »«. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0160 | Brug af forenklinger | <p>Når et selskab anvender forenklinger ved beregning af det individuelle teoretiske solvenskapitalkrav, indberettes det, inden for hvilket eller hvilke områder disse forenklinger anvendes. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Markedsrisici/kreditspændrisici (obligationer og lån) 2 — Markedsrisici/renterisici (captive-selskaber) 3 — Markedsrisici/kreditspændrisici (obligationer og lån) (captive-selskaber) 4 — Markedsrisici/markedskoncentrationsrisici (captive-selskaber) 5 — Modpartsrisici 6 — Livsforsikringsrisici/dødelighedsrisici 7 — Livsforsikringsrisici/levetidsrisici 8 — Livsforsikringsrisici/invaliditets- og sygdomsrisici 9 — Livsforsikringsrisici/optionsrisici 10 — Livsforsikringsrisici/omkostningsrisici for livsforsikringer 11 — Livsforsikringsrisici/livsforsikringskatastroferisici 12 — Sygeforsikringsrisici/dødelighedsrisici 13 — Sygeforsikringsrisici/levetidsrisici 14 — Sygeforsikringsrisici/invaliditets- og sygdomsrisici (udgifter til lægebehandling) 15 — Sygeforsikringsrisici/invaliditets- og sygdomsrisici (indkomstsikring) 16 — SLT-sygeforsikringsrisici/optionsrisici 17 — Sygeforsikringsrisici/omkostningsrisici for livsforsikringer 18 — Skadesforsikringsrisici/præmie- og erstatningshensættelsesrisici (captive-selskaber) <p>Angiv så mange optioner, som det er nødvendigt, adskilt med et »,«.</p> |
| C0170 | Anvendelse af partiel intern model | <p>Når et selskab anvender en eller flere partielle interne modeller til beregning af det individuelle teoretiske solvenskapitalkrav, indberettes det, inden for hvilket eller hvilke områder den eller disse anvendes.</p> |
| C0180 | Koncernintern model eller individuel intern model | <p>Når et selskab anvender en komplet intern model til beregning af det individuelle teoretiske solvenskapitalkrav, angives det, om det drejer sig om en individuel intern model eller en koncernintern model. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Individuel intern model 2 — Koncernintern model |

| | POST | VEJLEDNING |
|---|--|---|
| C0190 | Dato for oprindelig godkendelse af intern model | Hvis en koncernintern model eller en individuel intern model godkendes af en individuel tilsynsførende, angives ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for datoen for denne godkendelse. |
| C0200 | Dato for godkendelse af seneste større ændring af intern model | Hvis en større ændring af en koncernintern model eller en individuel intern model godkendes af en individuel tilsynsførende (artikel 115), angives ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for datoen for denne godkendelse. |
| C0210 | Dato for beslutning om kapitaltillæg | Hvis et kapitaltillæg vedrører et af de selskaber, der opregnes her (artikel 37 i direktiv 2009/138/EF), angives ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for datoen for godkendelsen. |
| C0220 | Kapitaltillæg | Hvis et kapitaltillæg vedrører en af de enheder, der opregnes her (artikel 37 i direktiv 2009/138/EF), indberettes det nøjagtige beløb. |
| C0230 | Begrundelse for kapitaltillæg | Hvis et kapitaltillæg vedrører et af de selskaber, der opregnes her (artikel 37 i direktiv 2009/138/EF), angives den eller de grunde, som den tilsynsførende har anført i sin beslutning. |
| <i>Ikke-EØS-forsikrings- og genforsikringsselskaber (som anvender eller ikke anvender Solvens II-regler), uanset anvendt metode</i> | | |
| C0240 | Lokalt solvenskapitalkrav | Lokalt individuelt kapitalkrav, som udløser det første indgreb fra den lokale tilsynsførendes side. |
| C0250 | Lokalt minimumskapitalkrav | Lokalt individuelt minimumskapitalkrav, som udløser det sidste indgreb — inddragelse af tilladelse — fra den lokale tilsynsførendes side. Beløbet skal bruges til at beregne koncernens konsoliderede minimumssolvenskapitalkrav. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0260 | Anerkendt kapitalgrundlag i henhold til lokale regler | Det anerkendte individuelle kapitalgrundlag til dækning af det lokale kapitalkrav, som beregnet i henhold til lokale regler, uden restriktioner vedrørende elementer, som ikke står til rådighed for koncernen. |
| C0270 | Bidrag udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav. | <p>Bidrag udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav.</p> <p>Hvis metode 1 anvendes, skal et datterselskabs bidrag til koncernens solvenskapitalkrav beregnes efter formlen:</p> $\text{Contrj} = \text{SCRj} \times \text{SCRdiversified} / \sum \text{SCRisolo}$ <p>hvor:</p> <ul style="list-style-type: none"> — SCRj er solvenskapitalkravet for den enkelte enhed for selskab j — SCRdiversified = solvenskapitalkravet beregnet i henhold til artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35. — SCRisolo er solvenskapitalkravet for den enkelte enhed i det deltagende selskab og ethvert tilknyttet forsikrings- eller genforsikringsselskab og tredjelandsforsikrings- og genforsikringsselskab, der indgår i beregningen af SCRdiversified — andelen er den proportionale justering som følge af indregningen af diversifikationseffekter på koncernniveau. <p>For tilknyttede forsikrings- og genforsikringsselskaber, som ikke er datterselskaber (artikel 335, stk. 1, litra d), i DR, og som er omfattet gennem metode 1, er det tilknyttede selskabs bidrag til solvenskapitalkravet på koncernniveau den forholdsmæssige andel af det individuelle solvenskapitalkrav.</p> <p>For metode 2 er det tilknyttede selskabs bidrag til koncernens solvenskapitalkrav den forholdsmæssige andel af det individuelle solvenskapitalkrav.</p> |

S.34.01 — Individuelle krav vedrørende andre regulerede finansielle selskaber og andre ikkeregulerede finansielle selskaber, herunder forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den indledende og årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

Dette skema anvendes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, eller når der anvendes en kombination af metoder, og omfatter individuelle krav vedrørende andre finansielle selskaber end forsikrings- og genforsikringsselskaber og vedrørende ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, jf. definitionen i artikel 1, nr. 52), i delegeret forordning (EU) 2015/35, f.eks. kreditinstitutter, investeringselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser, ikkeregulerede selskaber, der udøver finansielle aktiviteter, forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0010 | Registreret navn på selskab | Registreret navn på hvert selskab. |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Identifikationskode for selskabet«:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Aggregeret eller ikke | <p>Når enheder i andre finansielle sektorer udgør en koncern med et bestemt kapitalkrav, kan dette konsoliderede kapitalkrav accepteres i stedet for listen over de enkelte individuelle krav. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Aggregeret 2 — Ikkeaggregeret |
| C0050 | Type kapitalkrav | <p>Angiv type kapitalkrav. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Sektorrelateret (for kreditinstitutter, investeringsselskaber, finansieringsinstitutter, forvaltere af alternative investeringsfonde, UCITS-administrationselskaber, arbejdsmarkedsrelaterede pensionskasser) 2 — Teoretisk (for ikkeregulerede selskaber) 3 — Intet kapitalkrav |
| C0060 | Teoretisk solvenskapitalkrav og sektorrelateret kapitalkrav | Det kapitalkrav, enten sektorrelateret eller teoretisk, som udløser det første indgreb fra en individuel tilsynsførendes side, forudsat at der findes en såkaldt indgrebsskala. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0070 | Teoretisk minimumskapitalkrav og sektorrelateret minimumskapitalkrav | <p>Det minimumskapitalkrav, enten sektorrelateret eller teoretisk, som udløser det første indgreb fra en individuel tilsynsførendes side, forudsat at der findes en såkaldt indgrebsskala.</p> <p>Denne post er ikke relevant for enheder, som der ikke er fastsat et endeligt udløsningsniveau for.</p> |
| C0080 | Teoretisk eller sektorrelateret anerkendt kapitalgrundlag | Samlet kapitalgrundlag til dækning af det (teoretiske eller sektorrelaterede) kapitalkrav. Ingen restriktioner vedrørende elementer, som ikke står til rådighed for koncernen. |
| C0085 | Bidrag udgjort af det enkelte selskabs (teoretiske) solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav. | <p>Bidrag udgjort af det enkelte selskabs teoretiske solvenskapitalkrav til solvenskapitalkrav på koncernniveau med hensyn til forsikringsholdingselskaber og blandede finansielle holdingselskaber</p> <p>Bidrag udgjort af det enkelte selskabs solvenskapitalkrav til koncernens solvenskapitalkrav.</p> <p>Hvis metode 1 anvendes, skal et datterselskabs bidrag til koncernen beregnes efter formlen:</p> $\text{Contr}_j = \text{SCR}_j \times \text{SCR}_{\text{diversified}} / \sum_i \text{SCR}_{\text{isolo}}$ <p>hvor:</p> <ul style="list-style-type: none"> — SCR_j er solvenskapitalkravet for den enkelte enhed for selskab j — $\text{SCR}_{\text{diversified}}$ = solvenskapitalkravet beregnet i henhold til artikel 336, litra a), i delegeret forordning (EU) 2015/35. — $\text{SCR}_{\text{isolo}}$ er solvenskapitalkravet for den enkelte enhed i det deltagende selskab og ethvert tilknyttet forsikrings- eller genforsikringsselskab og tredjelandforsikrings- og genforsikringsselskab, der indgår i beregningen af $\text{SCR}_{\text{diversified}}$ — andelen er den proportionale justering som følge af indregningen af diversifikations-effekter på koncernniveau. <p>For tilknyttede selskaber, som ikke er datterselskaber (artikel 335, stk. 1, litra d), i DR, og som er omfattet gennem metode 1, er det tilknyttede selskabs bidrag til solvenskapitalkravet på koncernniveau den forholdsmæssige andel af det individuelle solvenskapitalkrav.</p> <p>For metode 2 er det tilknyttede selskabs bidrag til koncernens solvenskapitalkrav den forholdsmæssige andel af det individuelle solvenskapitalkrav.</p> |

3.35.01 — Bidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører den årlige indberetning af oplysninger for koncerner.

De oplysninger, der skal indberettes i C0050-C0210, skal være efter volatilitetsjustering, matchtilpasning og overgangsjustering. Overgangsfradraget i de forsikringsmæssige hensættelser oplyses separat i C0220 og C0230.

Dette skema anvendes, når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, eller metode 2, jf. artikel 233 i direktiv 2009/138/EF, anvendes, eller når der anvendes en kombination af metoder.

Tilknyttede forsikrings- og genforsikringsselskaber, som ikke er datterselskaber, er ikke omfattet af dette skema, idet de vurderes ved den justerede indre værdis metode.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0010 | Registreret navn på selskab | Registreret navn på hvert selskab |
| C0020 | Identifikationskode for selskab | <p>Identifikationskode ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0030 | ID-kodetype for selskab | <p>Angiv den kode, som anvendes under »Identifikationskode for selskabet«:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Beregningsmetode for koncernsolvens | <p>Angiv, hvilken metode der anvendes til at beregne koncernsolvens. Følgende udtømmende liste af valgmuligheder anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Metode 1 2 — Metode 2 |
| C0050 | Samlede forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Samlede forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner. Denne post svarer til summen af C0070, C0100, C0130, C0160, C0190 og C0220, undtagen for (gen)forsikringselskaber beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande under metode 2.</p> <p>For (gen)forsikringselskaber beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande under metode 2 er kun C0050 obligatorisk.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------------------|---|---|
| | | <p>Når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes i forbindelse med (gen) forsikringselskaber, svarer de samlede forsikringsmæssige hensættelser i C0050 til selskabets bidrag uden fradrag af genforsikring cederet inden for koncerntilsynets rammer til koncernens forsikringsmæssige hensættelser.</p> <p>Når metode 2 anvendes i forbindelse med (gen)forsikringselskaber, kan de samlede forsikringsmæssige hensættelser i C0050 ikke afstemmes med koncernens forsikringsmæssige hensættelser på koncernbalancen.</p> |
| C0060 | Samlede forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser med fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Samlede forsikringsmæssige hensættelser med fradrag af koncerninterne transaktioner.</p> <p>Denne post svarer til summen af C0080, C0110, C0140, C0170, C0200 og C0230, undtagen for (gen)forsikringselskaber beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande under metode 2.</p> <p>For (gen)forsikringselskaber beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande med mulighed for at anvende lokale regler under metode 2 er kun C0060 obligatorisk, og cellen udfyldes i overensstemmelse med den lokale solvensordning.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring, men med fradrag af koncerninterne transaktioner, herunder koncernintern genforsikring (risikomarginen bør ikke angives med fradrag af koncerninterne transaktioner).</p> <p>Når metode 1, jf. artikel 230 i direktiv 2009/138/EF, anvendes i forbindelse med (gen) forsikringselskaber, svarer de samlede forsikringsmæssige hensættelser i C0060 til selskabets bidrag med fradrag af genforsikring cederet inden for koncerntilsynets rammer til koncernens forsikringsmæssige hensættelser. De samlede forsikringsmæssige hensættelser i C0060 for alle (gen)forsikringselskaber under metode 1 kan ikke afstemmes med koncernens forsikringsmæssige hensættelser på koncernbalancen.</p> <p>Når metode 2 anvendes i forbindelse med (gen)forsikringselskaber, kan de samlede forsikringsmæssige hensættelser i C0060 ikke afstemmes med koncernens forsikringsmæssige hensættelser på koncernbalancen.</p> |
| C0070, C0100, C0130, C0160 og C0190 | Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Forsikringsmæssige hensættelser (forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et eller summen af det bedste skøn og risikomarginen) fordelt på de respektive hovedkategorier (Livsforsikring, eksklusive sygeforsikring og unit-linked og indeksreguleret, Unit-linked og indeksreguleret, SLT-sygeforsikring og ikke-SLT, Skadesforsikring, eksklusive sygeforsikring) i EØS- eller ikke-EØS-selskaber, beregnet i overensstemmelse med Solvens II-reglerne.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner.</p> <p>Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta.</p> <p>Denne post indberettes for (gen)forsikringselskaber under metode 1 og metode 2, undtagen for (gen)forsikringselskaber under metode 2 beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------------------------|---|---|
| C0080, C0110, C0140, C0170 og C0200 | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | <p>Forsikringsmæssige hensættelser (forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et eller summen af det bedste skøn og risikomarginen) fordelt på de respektive hovedkategorier (Livsforsikring, eksklusive sygeforsikring og unit-linked og indeksreguleret, Unit-linked og indeksreguleret, SLT-sygeforsikring og ikke-SLT, Skadesforsikring, eksklusive sygeforsikring) i EØS- eller ikke-EØS-selskaber, beregnet i overensstemmelse med Solvens II-reglerne.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring, men med fradrag af koncerninterne transaktioner, herunder koncernintern genforsikring.</p> <p>Den valuta, som benyttes, er koncernens indberetningsvaluta.</p> <p>Denne post indberettes for (gen)forsikringsselskaber under metode 1 og metode 2, undtagen for (gen)forsikringsselskaber under metode 2 beliggende i tilsvarende ikke-EØS-lande.</p> |
| C0090, C0120, C0150, C0180 og C0210 | Nettobidrag til koncernens forsikringsmæssige hensættelser (%) | <p>(Gen)forsikringsselskabets procentvise andel af de forsikringsmæssige hensættelser (forsikringsmæssige hensættelser beregnet under et eller summen af det bedste skøn og risikomarginen) af koncernens forsikringsmæssige hensættelser under metode 1, med fradrag af koncerninterne transaktioner, men uden fradrag af genforsikring cederet uden for koncernen, fordelt på de respektive hovedkategorier (Livsforsikring, undtagen sygeforsikring og unit-linked og indeksreguleret, Unit-linked og indeksreguleret, SLT-sygeforsikring og ikke-SLT, Skadesforsikring, eksklusive sygeforsikring).</p> <p>Denne post indberettes ikke for selskaber under metode 2.</p> |
| C0220 | Overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser. Dette beløb indgår ikke i de foregående poster.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> |
| C0230 | Overgangsforanstaltninger vedrørende forsikringsmæssige hensættelser — Forsikringsmæssige hensættelser med fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Overgangsfradrag i forsikringsmæssige hensættelser. Dette beløb indgår ikke i de foregående poster.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring, men med fradrag af koncerninterne transaktioner, herunder koncernintern genforsikring.</p> <p>Denne værdi skal indberettes som en negativ værdi.</p> |
| C0240 | Langsigtede garantier — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af overgangsjustering af risikofri rentekurve—Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | <p>Angiv de samlede forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner (C0050) omfattet af overgangsjusteringen af den relevante risikofrie rentekurve.</p> <p>I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0250 | Langsigtede garantier — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af volatilitetsjustering — Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | Angiv de samlede forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner (C0050) omfattet af volatilitetsjustering. De forsikringsmæssige hensættelser indberettes efter overgangsforanstaltninger og med risikomargin. I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner, herunder koncernintern genforsikring. |
| C0260 | Langsigtede garantier — Forsikringsmæssige hensættelser omfattet af matchtilpasning — Forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner | Angiv de samlede forsikringsmæssige hensættelser uden fradrag af koncerninterne transaktioner (C0050) omfattet af matchtilpasning. I cellen angives beløb uden fradrag af genforsikring og koncerninterne transaktioner, herunder koncernintern genforsikring. |

S.36.01 — Koncerninterne transaktioner — Transaktioner af egenkapitaltypen, gælds- og aktivoverførsel

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører indgivelsen af de oplysninger, som koncerner skal afgive mindst en gang om året.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder i en koncern, i forbindelse med kapitalandele, gæld, indbyrdes finansiering ⁽²⁾ og overførsel af aktiver.

De omfatter, men er ikke begrænset til:

- egenkapital og andres kapitalposter, inklusive andele i tilknyttede enheder og aktier overført fra tilknyttede enheder i koncernen
- gæld, herunder obligationer, lån, sikret gæld og andre transaktioner af lignende karakter, f.eks. med periodiske forud fastsatte rente-, kupon- eller præmiebetalinger i en forud fastsat periode
- andre aktivoverførsler, f.eks. overførsel af ejendomme og overførsel af aktier fra andre selskaber, som ikke er knyttet til (dvs. uden for) koncernen.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

⁽²⁾ Som fastsat i artikel 223 i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Investors/långivers navn | Navnet på den enhed, der køber aktier eller låner penge til et tilknyttet selskab i koncernen, dvs. den enhed, der indregner transaktionen som et aktiv på sin balance (debit — balance). |
| C0030 | Identifikationskode for investor/långiver | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikrings-selskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p style="margin-left: 20px;">identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---|---|
| C0031 | Kodetype for investor/långiver | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/långiver«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| NC0040 | Sektoren for investor/långiver | <p>Hvis udsteder/långiver er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/långiver ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Udsteders/låntagers navn | <p>Navnet på den enhed, der udsteder aktier/kapitalposter eller låner penge (udsteder gæld) dvs. den enhed, der indregner transaktionen som en forpligtelse eller som kapital på sin balance (kredit — balance).</p> |
| C0060 | Identifikationskode for udsteder/låntager | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal det finansielle konglomerat konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0061 | Kodetype for udsteder/låntager | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udsteder/låntager«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---------------------------------|--|
| NC0070 | Sektor for udsteder/låntager | <p>Hvis udsteder/låntager indgår i den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/låntager ikke indgår i den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives »andet selskab i koncernen«.</p> |
| NC0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0100 | ID-kode for instrument | <p>Identifikationskoden for instrumentet (kapital, gæld osv.) mellem de to modparter ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være konsistent over tid. <p>Den kan være forskellig fra den koncerninterne transaktionskode under C0010.</p> |
| NC0101 | ID-kodetype for instrument | <p>Type ID-kode anvendt under »ID-kode for instrument«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|------------------------------|--|
| NC0110 | Instrumenttype | <p>Angiv instrumenttypen.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Obligationer/Gæld</p> <p>2 — Egenkapitaltype</p> <p>3 — Anden aktivoverførsel</p> |
| NC0120 | Instrument | <p>Angiv instrumentet. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — Obligationer/Gæld — med sikkerhedsstillelse</p> <p>2 — Obligationer/Gæld — uden sikkerhedsstillelse</p> <p>3 — Egenkapitaltype — aktier/kapitalandele</p> <p>4 — Egenkapitaltype — andet</p> <p>5 — Anden aktivoverførsel — ejendomme</p> <p>6 — Anden aktivoverførsel — andet</p> |
| NC0130 | Udstedelsesdato | <p>Den dato, der kommer først af transaktions-/gældsudstedelsesdatoen eller den dato, fra hvilken den koncerninterne transaktion er effektiv, hvis forskellig fra udstedelsesdato.</p> <p>Datoen angives i ISO 8601-format (åååå-mm-dd).</p> |
| NC0140 | Udløbsdato | <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor transaktionen udløber/forfalder, hvis det er relevant.</p> <p>— For koncerninterne transaktioner uden udløbsdato anvendes »9999-12-31«.</p> <p>— For uomortisable værdipapirer anvendes »9999-12-31«.</p> |
| NC0150 | Transaktionsvaluta | <p>Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen.</p> |
| NC0160 | Beløb på transaktionsdatoen | <p>Transaktionsbeløb på transaktionsdatoen, indberettet i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| NC0170 | Beløb på indberetningsdatoen | <p>Transaktionens udestående beløb på indberetningsdatoen, hvis det er relevant, f.eks. for gældsudstedelse, i koncernens indberetningsvaluta. Ved en fuldstændig førtidig afvikling/førtidig indfrielse er saldoen af det aftalerelaterede beløb nul.</p> |
| NC0180 | Værdi af sikkerhedsstillelse | <p>Sikkerhedsstillelsens værdi for gæld med sikkerhedsstillelse eller aktiverens værdi for koncerninterne transaktioner, der omfatter aktivoverførsel, i koncernens indberetningsvaluta.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|--|---|
| NC0190 | Udbytte/renter/kuponer og andre betalinger i indberetningsperioden | <p>I denne celle gengives samtlige betalinger i forhold til de koncerninterne transaktioner, der er angivet i dette skema for indberetningsperioden (seks måneder forud for indberetningsdatoen).</p> <p>De omfatter, men er ikke begrænset til:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Udbytte i det indeværende år, herunder udbetalt eller uddelt, men ikke udbetalt, udbytte. — Udskudt udbytte fra tidligere år udbetalt i indberetningsperioden (dvs. udbetalt udskudt udbytte med indvirkning på P&L i indberetningsperioden). — Rentebetalinger i forhold til gældsinstrumenter. — Samtlige betalinger i forhold til de koncerninterne transaktioner, der er angivet i dette skema f.eks. udgifter ved aktivoverførsel. — Samlede supplerende beløb, hvis det er relevant, dvs. det samlede yderligere beløb investeret i indberetningsperioden, f.eks. yderligere indbetaling i forbindelse med delvist betalte aktier eller forøgelse af lån i perioden (når supplerende beløb indberettes som en særskilt post). <p>Beløbet angives i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| C0200 | Kupon-/rentesats | Rente- eller kuponsatsen udtrykt i procent, hvis det er relevant. For variable rentesatser omfatter det referencesatsen og rentesatsen herover. |
| C0210 | Bemærkninger | <p>Bemærkningerne skal indeholde:</p> <ul style="list-style-type: none"> — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.02 — Koncerninterne transaktioner — Derivater

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører indgivelsen af de oplysninger, som koncerner skal afgive mindst en gang om året.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn i forbindelse med derivater. Betydelige koncerninterne transaktioner i forbindelse med derivater indberettes, hvis den regnskabsmæssige værdi af derivatet overstiger tærsklen. De omfatter, men er ikke begrænset til:

- renteaftaler, herunder swaps, forwards, futures og optioner
- valutakurskontrakter, herunder swaps, forwards, futures og optioner
- kontrakter af samme art som dem, der er nævnt i nærværende bilags punkt 1, litra a)-e), og punkt 2, litra a)-d), med andre underliggende instrumenter eller indekser.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Investors/købers navn | Navnet på den enhed, som investerer i/køber derivatet, eller modparten med den lange position. Ved swaps er betaleren den, der betaler den faste rente og modtager den variable rente. |
| C0030 | Identifikationskode for investor/køber | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---|---|
| C0031 | Kodetype for investor/køber | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/køber«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| NC0040 | Sektoren for investor/køber | <p>Hvis investor/køber er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis investor/køber ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Udsteders/sælgers navn | <p>Navnet på den enhed, som udsteder/sælger derivatet, eller modparten med den korte position. Ved swaps er modtageren den, der modtager de faste renter og betaler den variable rente.</p> |
| C0060 | Identifikationskode for investor/sælger | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringssekskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0061 | Kodetype for udsteder/sælger | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udsteder/sælger«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| NC0070 | Finanssektor for investor/sælger | <p>Hvis udsteder/sælger er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis udsteder/sælger ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---------------------------------|--|
| NC0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i cellen. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| NC0100 | ID-kode for instrument | <p>Identifikationskoden for instrumentet (kapital, gæld osv.) mellem de to modparter ved hjælp af nedenstående koder (i prioriteret rækkefølge):</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige. Koden skal være konsistent over tid. <p>Den kan være forskellig fra den koncerninterne transaktionskode under C0010.</p> |
| NC0101 | ID-kodetype for instrument | <p>Type ID-kode anvendt under »ID-kode for instrument«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166 2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures)) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer) 5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies 99 — Kode tildelt af selskabet |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---------------------------|---|
| NC0110 | Instrumenttype | <p>Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Derivater — futures 2 — Derivater — forwards 3 — Derivater — optioner 4 — Derivater — andre 5 — Garantier — kreditrisikoafdækning 6 — Garantier — andre 7 — Swaps 8 — Andet <p>En genkøbsaftale bør betragtes som en kontantforretning plus en forward-kontrakt.</p> |
| NC0120 | Type afdækning | <p>Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — credit default 2 — renter 3 — valuta 4 — andre |
| NC0130 | Formålet med instrumentet | <p>Beskriv brugen af derivatet (mikro-/makroafdækning, effektiv porteføljeforvaltning). Mikroafdækning vedrører derivater, der dækker ét enkelt finansielt instrument, én enkelt forventet transaktion eller én enkelt forpligtelse. Makroafdækning vedrører derivater, der dækker et sæt finansielle instrumenter, forventede transaktioner eller forpligtelser. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Mikroafdækning 2 — Makroafdækning 3 — Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser 4 — Effektiv porteføljeforvaltning bortset fra »Matchning af cash flow for aktiver og forpligtelser«. 5 — Andet |
| NC0140 | Startdato | <p>Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor transaktionen foregår/derivatkontrakten handles. Ved rullende aftaler angives den oprindelige handelsdato.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|--|---|
| NC0150 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den kontraktligt fastsatte dato for derivatkontraktens afslutning, hvad enten det er forfaldsdatoen, udløbsdatoen for optioner (europæiske eller amerikanske) osv. |
| NC0160 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen. |
| NC0170 | Notionel værdi | <p>Det beløb, der er dækket eller eksponeret i forhold til derivatet på indberetningsdatoen, dvs. ultimobalancen, i koncernens indberetningsvaluta.</p> <p>For futures og optioner svarer det til aftalestørrelse ganget med antal aftaler. For swaps og forwards svarer det til aftalebeløbet. Hvis en transaktion er forfaldet/udløbet i indberetningsperioden før indberetningsdatoen, er det notionelle beløb på indberetningsdatoen nul.</p> |
| NC0180 | Regnskabsmæssig værdi | <p>Derivatets værdi på indberetningsdatoen som indberettet i selskabets balance.</p> <p>Hvis en transaktion er forfaldet/udløbet i indberetningsperioden før indberetningsdatoen, skal den regnskabsmæssige værdi på indberetningsdatoen være den maksimale regnskabsmæssige værdi for derivaterne, før transaktion forfalder.</p> |
| NC0190 | Værdi af sikkerhedsstillelse | Værdi af den stillede sikkerhed på indberetningsdatoen (nul, hvis derivatet er afviklet), hvis det er relevant, indberettet i det finansielle konglomerats indberetningsvaluta. |
| NC0200 | Identifikationskode for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet | <p>ID-kode for det underliggende aktiv eller en underliggende forpligtelse for derivatkontrakten. Denne post skal indberettes for derivater, der har et enkelt underliggende instrument eller indeks i selskabets portefølje.</p> <p>Et indeks betragtes som et enkelt instrument og skal indberettes.</p> <p>Identifikationskode for det underliggende instrument for derivatet i følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISIN-kode ifølge ISO 6166, hvis tilgængelig — Andre anerkendte koder (f.eks.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Kode, der tildeles af selskabet, når ovenstående muligheder ikke er tilgængelige; koden skal være konsistent over tid — »Mange aktiver/forpligtelser«, hvis der er mere end ét underliggende aktiv eller én underliggende forpligtelse. <p>Hvis det underliggende instrument er et indeks, så indberettes koden for indekset.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|--------|---|---|
| NC0201 | Kodetype for det aktiv eller den forpligtelse, der ligger til grund for derivatet | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for det underliggende aktiv eller den underliggende forpligtelse for derivatet«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — ISIN-kode ifølge ISO 6166</p> <p>2 — CUSIP (det nummer, der tildeles af CUSIP Service Bureau for selskaber i USA og Canada (CUSIP = Committee on Uniform Securities Identification Procedures))</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List for London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapier Kenn-Nummer, Tysklands alfanumeriske identifikationsnummer)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (bogstavkode fra Bloomberg, der identificerer et selskabs værdipapirer)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters-kode for instrumenter)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Anden kode fra medlemmerne af Association of National Numbering Agencies</p> <p>99 — Kode tildelt af selskabet Denne valgmulighed anvendes ligeledes i forbindelse med »Mange aktiver/forpligtelser« og indeks.</p> |
| NC0210 | Navn på modpart, for hvilken der er købt kreditrisikoafdækning | Navnet på den modpart, for hvis misligholdelse der er købt kreditrisikoafdækning. |
| NC0220 | Swaps — Betalt rente ved en swap (for køber) | Rente betalt i henhold til swapaftalen (kun for renteswaps). |
| NC0230 | Swaps — Modtaget rente ved en swap (for køber) | Rente modtaget i henhold til swapaftalen (kun for renteswaps). |
| NC0240 | Swaps — Afleveret valuta ved en swap (for køber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for swappriisen (kun for valutaswaps). |
| C0250 | Swaps — Modtaget valuta ved en swap (for køber) | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for valutaen for swappens nominelle beløb (kun for valutaswaps). |
| C0260 | Indtægter fra derivater | Nettoindtægter fra investering i eller køb af derivater. I henhold til det IFRS-baserede P&L angives både de realiserede og ikke-realiserede resultater her. Beløbene angives i deres rene værdi (sammenlignet med QRT S.09.01. SII). Renterne indberettes i S.36.05 P&L. |
| C0270 | Bemærkninger | <p>Bemærkningerne skal indeholde:</p> <ul style="list-style-type: none"> — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.03 — Koncerninterne transaktioner — Ikke balanceførte poster og eventualforpligtelser

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører indgivelsen af de oplysninger, som koncerner skal afgive mindst en gang om året.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn i forbindelse med ikkebalanceførte garantier.

Heri medregnes blandt andet:

- ikkebalanceførte garantier
- uudnyttede kreditfaciliteter
- aktiver, der er indkøbt i henhold til direkte forwards (valuta eller andet)
- salgs- og genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 12, stk. 3 og 5, i direktiv 86/635/EØF
- eventualforpligtelser.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Navnet på garantistiller | Navnet på den enhed, der stiller den ikkebalanceførte garanti. |
| C0030 | Identifikationskode for garantistiller | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til garantistiller, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge, hvis den findes:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildelt af det finansielle konglomerat. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0031 | Kodetype for garantistiller | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for garantistiller«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Garantistillers finansielle sektor | <p>Hvis garantistiller er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis garantistiller ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Modtagerens navn | Navnet på den enhed, der drager fordel af den ikkebalanceførte garanti. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0060 | Identifikationskode for den begunstigede | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den begunstigede, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0061 | Kodetype for den begunstigede | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for den begunstigede«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0070 | Den begunstigedes finansielle sektor | <p>Hvis den begunstigede er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis den begunstigede ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0100 | Transaktionstype | <p>Angiv transaktionstypen. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — garantier</p> <p>2 — forpligtelser</p> <p>3 — remburs</p> <p>4 — uudnyttede kreditfaciliteter</p> <p>5 — aktiver, der er indkøbt i henhold til direkte forwards (valuta eller andet)</p> <p>6 — salgs- og genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 12, stk. 3 og 5, i direktiv 86/635/EØF</p> <p>7 — eventualforpligtelser</p> <p>8 — andet.</p> |
| C0110 | Transaktions udstedelsesdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken transaktionen/udstedelsen træder i kraft. |
| C0120 | Udløbsdato for den aftale, der ligger til grund for transaktionen | Angiv i givet fald ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, på hvilken aftalen udløber. Hvis der ikke er nogen udløbsdato, angives »9999-12-31«. |
| C0130 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, der blev anvendt ved gennemførelse af transaktionen. Hvis der er tale om to valutaer, angives begge i cellen »Bemærkninger C0200«. |
| C0140 | Udløsende begivenhed | En kort beskrivelse af begivenhed, der ville udløse transaktionen/betalingen/forpligtelsen/ingen, f.eks. begivenhed, der ville medføre en eventualforpligtelse. |
| C0150 | Transaktionsværdi på startdato | <p>Værdi af transaktionen eller den stillede sikkerhed</p> <p>Denne post skal indberettes i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| C0160 | Transaktionsværdi på indberetningsdato | <p>Værdi af transaktionen eller den stillede sikkerhed</p> <p>Denne post angives i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| C0170 | Højeste mulige værdi af eventualforpligtelser | Højeste mulige værdi, om muligt, uanset sandsynligheden derfor (dvs. fremtidige cash flow, der er nødvendige for at honorere eventualforpligtelsen frem til dennes udløb, diskonteret med den relevante risikofrie rentekurve), af eventualforpligtelser, der er opført på koncernens balance. Summen af alle mulige cash flow, hvis de begivenheder, der udløser garantier, alle indtraf i forbindelse med garantier stillet af »garantistilleren« (C0020) over for den »begunstigede« (C0050) for at garantere betaling af selskabets forpligtelser (heri medregnes remburs og uudnyttede lånefaciliteter). Under denne post medregnes ikke beløb, der allerede er indberettet under C0150 og C0160. |

| | POST | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------------|---|
| C0180 | Værdi af garanterede aktiver | Værdi af de garanterede aktiver, for hvilke garantierne er modtaget. Sektorbestemte værdiansættelsesprincipper kan være relevante i dette tilfælde. |
| C0190 | Indtægter fra ikkebalanceførte poster | Indtægter i relation til hensættelser for ikkebalanceførte transaktioner. |
| C0200 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.04 — Koncerninterne transaktioner — Forsikring og genforsikring

Generelle bemærkninger:

Dette skema vedrører indgivelsen af de oplysninger, som koncerner skal afgive på årsbasis.

I skemaet indberettes alle koncerninterne transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn i forbindelse med koncerntern forsikring og genforsikring.

Heri medregnes blandt andet:

- forsikringsaftaler for selskaber, der er omfattet af koncernen, indgået med forsikringselskaber inden for koncernen
- genforsikringsaftaler mellem tilknyttede selskaber i en koncern
- fakultativ genforsikring mellem tilknyttede selskaber i en koncern og
- alle andre transaktioner, som medfører overførsel af forsikringsrisici mellem tilknyttede selskaber i en koncern.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. |
| C0020 | Navnet på forsikringstager/cedent | Det registrerede navn på den enhed, som har overført forsikringsrisikoen til et andet forsikringsselskab eller genforsikringsselskab inden for koncernen. |
| C0030 | Identifikationskode for forsikringstager/cedent | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode Specifik kode: <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0031 | Kode for forsikrings-tager/cedent | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for investor/långiver«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0040 | Sektor for forsikrings-tager/cedent | <p>Hvis forsikringstager/cedenten er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis forsikringstager/cedenten ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Navn på forsikrings-/genforsikringsselskabet | <p>Det registrerede navn på det forsikrings-/genforsikringsselskab, som forsikringsrisikoen er overført til.</p> |
| C0060 | Identifikationskode for forsikrings-/genforsikringsselskabet | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0061 | Kodetype for forsikrings-selskab/genforsikringsselskab | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for forsikrings-/genforsikringsselskab«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <p>1 — LEI-kode</p> <p>2 — Specifik kode</p> |
| C0070 | Sektor for forsikrings-/genforsikringsselskabet | <p>Den finansielle sektor for garantistilleren, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, dvs. »forsikrings- og genforsikringsselskab«.</p> <p>Denne kolonne skal anvendes til en tilpasning i forhold til de skemaer, der er anvendt på niveauet for det finansielle konglomerat.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---------------------------------|--|
| C0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0100 | Transaktionstype | <p>Angiv aftale- eller kontrakttype. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — sygeforsikring 2 — sygegenforsikring |
| C0110 | Transaktion | <p>Hvis C0100 = genforsikring, angives typen af genforsikringsaftale/kontrakt. Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — kvoteandel 2 — variabel kvoteandel 3 — overskud 4 — skadesexcedent (pr. begivenhed og pr. risiko) 5 — skadesexcedent (pr. risiko) 6 — skadesexcedent (pr. begivenhed) 7 — »back-up« for skadesexcedent (beskyttelse mod efterfølgende begivenheder, som visse katastrofer kan forårsage, f.eks. oversvømmelse og brand) 8 — skadesexcedent med basisrisiko 9 — genindsættelsesdækning 10 — aggregeret skadesexcedent 11 — ubegrænset skadesexcedent 12 — stop loss 13 — andre proportionale aftaler |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|---|--|
| | | <p>14 — andre ikkeproportionale aftaler</p> <p>15 — finansiel genforsikring</p> <p>16 — fakultativ proportional</p> <p>17 — fakultativ ikkeproportional</p> <p>Andre proportionale aftaler (kode 13) og andre ikkeproportionale aftaler (kode 14) kan anvendes til kombinerede genforsikringsaftaler.</p> |
| C0120 | Startdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale eller -kontrakt træder i kraft. |
| C0130 | Udløbsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor den særlige genforsikringsaftale udløber (dvs. den sidste dag, hvor den specifikke genforsikringsaftale eller -kontrakt er i kraft). Denne post skal ikke indberettes, hvis der ikke er nogen udløbsdato (f.eks. hvis aftalen er fortløbende og ophører, hvis en af parterne opsiger den). |
| C0140 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, hvori betalinger vedrørende den specifikke genforsikringsaftale eller -kontrakt skal finde sted. |
| C0150 | Dent maksimale dækningsbeløb for en transaktion | <p>For aftaler af kvoteandels- eller overskudstypen skal 100 % af det maksimumsbeløb, der er fastsat for hele aftalen/kontrakten angives her (f.eks. 10 mio. EUR). I tilfælde af ubegrænset dækning anføres »-1«.</p> <p>Denne post skal indberettes i transaktionsvalutaen.</p> |
| C0160 | Nettertilgodehavender | <p>Beløbet stammer fra: erstatninger udbetalt af (gen)forsikringsselskabet, men som endnu ikke er refunderet af (gen)forsikringsselskabet, plus provision, som skal betales af (gen)forsikringsselskabet, plus andre tilgodehavender minus gæld til (gen)forsikringsselskabet. Kontante indskud medregnes ikke og skal betragtes som modtagne garantier.</p> <p>Denne post skal indberettes i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| C0170 | Samlet beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler | <p>Samlet forfaldent tilgodehavende hos genforsikringsselskabet på indberetningsdatoen, hvori medregnes:</p> <p>Præmiehensættelser for den del af den fremtidige genforsikringspræmie, som allerede er betalt til genforsikringsselskabet</p> <p>Erstatningshensættelser for forsikringsselskabets udestående krav, som skal betales af genforsikringsselskabet, og/eller</p> <p>Forsikringsmæssige hensættelser for det beløb, der afspejler genforsikringsandelen af de forsikringsmæssige bruttohensættelser. Denne post skal indberettes i koncernens indberetningsvaluta.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0180 | Genforsikringsteknisk resultat (for genforsikring) | <p>Genforsikringsresultat (for den genforsikrede enhed):</p> <p>Den samlede provision fra genforsikring modtaget af den genforsikrede enhed med fradrag af bruttopræmier fra genforsikring indbetalt af den genforsikrede enhed plus erstatninger udbetalt af genforsikringsselskabet i indberetningsperioden</p> <p>plus de samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, ved udgangen af indberetningsperioden,</p> <p>med fradrag af de samlede beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler, ved begyndelsen af indberetningsperioden.</p> <p>Denne post skal indberettes i koncernens indberetningsvaluta.</p> |
| C0190 | Præmier (for forsikring) | <p>Samlet værdi af tegnede præmier, brutto, som defineret i artikel 1, nr. 11), i delegeret forordning (EU) 2015/35.</p> <p>For annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler er denne celle ikke relevant.</p> |
| C0200 | Erstatninger (for forsikring) | <p>Samlet værdi af udbetalte erstatninger, brutto, i løbet af året, herunder skadesbehandlingsomkostninger.</p> |
| C0210 | Branche | <p>Navn på den branche, jf. bilag I til delegeret forordning (EU) 2015/35, som genforsikres.</p> <p>Følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Forsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 2 — Indkomstsikring 3 — Arbejdsskadeforsikring 4 — Motoransvarsforsikring 5 — Anden motorforsikring 6 — Sø-, luftfarts- og transportforsikring 7 — Forsikring mod brand og andre skader på ejendom 8 — Almindelig ansvarsforsikring 9 — Kredit- og kaufionsforsikring 10 — Retshjælpsforsikring 11 — Assistance 12 — Diverse økonomiske tab 13 — Proportional genforsikring vedrørende udgifter til lægebehandling 14 — Proportional genforsikring vedrørende indkomstsikring 15 — Proportional arbejdsskadegenforsikring |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------|---|
| | | <p>16 — Proportional motoransvarsgenforsikring</p> <p>17 — Proportional anden motorgenforsikring</p> <p>18 — Proportional sø-, luftfarts- og transportgenforsikring</p> <p>19 — Proportional genforsikring mod brand og andre skader på ejendom</p> <p>20 — Proportional almindelig ansvarsgenforsikring</p> <p>21 — Proportional kredit- og kautionsgenforsikring</p> <p>22 — Proportional retshjælpsgenforsikring</p> <p>23 — Proportional genforsikring vedrørende assistance</p> <p>24 — Proportional genforsikring vedrørende diverse økonomiske tab</p> <p>25 — Ikkeproportional sygegenforsikring</p> <p>26 — Ikkeproportional ulykkesgenforsikring</p> <p>27 — Ikkeproportional luftfarts-, sø- og transportgenforsikring.</p> <p>28 — Ikkeproportional ejendomsgenforsikring.</p> <p>29 — Forsikring med gevinstandele</p> <p>30 — Indeksreguleret og unit-linked forsikring</p> <p>31 — Anden livsforsikring</p> <p>32 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>33 — Annuiteter hidrørende fra skadesforsikringsaftaler og relateret til andre forsikringsforpligtelser end sygeforsikringsforpligtelser</p> <p>34 — Livsgenforsikring.</p> <p>35 — Sygeforsikring</p> <p>36 — Sygegenforsikring — Hvis en genforsikringsaftale dækker mere end én branche, vælges den vigtigste branche ud fra ovenstående liste.</p> |
| C0220 | Bemærkninger | <p>Bemærkningerne skal indeholde:</p> <ul style="list-style-type: none"> — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.36.05 — Koncerninterne transaktioner — P&L (overskud og tab)

Generelle bemærkninger:

Dette bilag vedrører indgivelsen af de oplysninger, som koncerner skal afgive en gang om året.

I skemaet indberettes alle koncerninterne P&L-transaktioner (betydelige, meget betydelige og transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes) mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn, eller P&L-transaktioner, der anses for at være betydelige eller meget betydelige koncerninterne transaktioner eller for at være transaktioner, der under alle omstændigheder skal indberettes. Heri medregnes blandt andet:

- Gebyrer
- Provisioner
- Renter
- Udbytter
- Omkostninger eller indtægter fra outsourcing, intern omkostningsdeling eller lejeaftaler.

Koncernintern outsourcing eller intern omkostningsdeling, der fører til betydelige koncerninterne transaktioner skal indberettes.

Selv om renter og udbytte indberettes i S.36.01 og S.36.02, skal de også indberettes i S.36.05 P&L.

Dette skema skal indeholde de koncerninterne transaktioner, der:

- var igangværende ved begyndelsen af indberetningsperioden
- blev indledt i løbet af indberetningsperioden, og som er udestående på indberetningsdatoen
- blev indledt og udløb i løbet af indberetningsperioden.

Hvis to eller flere transaktioner mellem enheder i koncernen, som ud fra et økonomisk perspektiv bidrager til samme risiko eller tjener samme formål/mål, eller er midlertidigt forbundet i en plan, skal disse anses for et være én enkelt økonomisk transaktion.

Hver enkelt af en sådan transaktion, som er en del af én enkelt økonomisk transaktion, skal indberettes, når de samlet svarer til eller er over den tilsvarende tærskel for betydelige koncerninterne transaktioner, også selv om den enkelte transaktioner ligger under tærsklen

Ethvert element, der tilføjes til den betydelige koncerninterne transaktion, indberettes som en særskilt koncernintern transaktion, selv hvis elementet i sig selv ligger under tærsklen for betydelige transaktioner. Hvis et selskab f.eks. øger det oprindelige lånebeløb til et andet tilknyttet selskab, indberettes dette supplement til lånet særskilt med udstedelsesdatoen som datoen for supplementet.

Hvis transaktionsværdien ikke er den samme for de to parter i en transaktion (f.eks. hvis A, i forbindelse med en transaktion på 10 mio. EUR mellem A og B, indberetter 10 mio. EUR, og B kun modtager 9,5 mio. EUR på grund af transaktionsomkostninger på f.eks. 0,5 mio. EUR), indberettes det største beløb i skemaet som transaktionsbeløbet, i dette tilfælde 10 mio. EUR.

Indirekte transaktioner defineres som enhver transaktion, der medfører skift af risikoeksponering mellem enheder inden for koncernen, inklusive men ikke begrænset til transaktioner med special purpose vehicles, kollektive investeringsinstitutter, accessoriske enheder eller uregulerede enheder, eller enheder uden for koncernen, men i sidste ende tilbageføres risikoeksponeringen til koncernen eller den forbliver deri. Hvis der er en kæde af forbundne koncerninterne transaktioner (f.eks. A investerer i B, og B investerer i C), indberettes denne transaktion som en indirekte transaktion. Derfor indberettes A til C-transaktionen, og i bemærkningen anføres det midlertidige trin. Ved transaktioner efter vandfaldsmodellen, f.eks. hvis »A«-> »B« -> »C«-> »D«, hvor både »B« og »C« er i koncernen, men er uregulerede enheder, indberettes også denne transaktion.

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|--|
| C0010 | Koncernintern transaktions-ID | Unik intern identifikationskode for hver enkelt koncernintern transaktion. Den skal være konsistent over tid. Hvis den vedrører allerede nævnte transaktioner, anvendes den samme ID. |
| C0020 | Navnet på indtægtssiden | Det juridiske navn på den enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen. |
| C0030 | Identifikationskode for indtægtsside | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den enhed, der fik indtægten, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0031 | Kodetype for indtægts-siden | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for indtægtssiden«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0040 | Sektoren for indtægts-siden | <p>Hvis enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis enhed, der har modtaget indtægten af en anden enhed i koncernen ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0050 | Navnet på udgiftssiden | Det juridiske navn på den enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen. |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------------------------|--|
| C0060 | Identifikationskode for indtægtsside | <p>Den unikke identifikationskode, der er knyttet til den enhed, der skaffede indtægten, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier) er obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Specifik kode:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, der indgår i koncernen: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — For ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber inden for koncernen: identifikationskode tildeles af koncernen. <p>Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0061 | Kodetype for udgiftsside | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for udgiftssiden«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |
| C0070 | Sektoren for udgiftssiden | <p>Hvis enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), i direktiv 2002/87/EF, angives: »banksektor«, »forsikrings- og genforsikringssektor« »sektor for investeringstjenester«.</p> <p>Hvis enhed, der har genereret indtægten til en anden enhed i koncernen ikke er en del af den finansielle sektor, jf. artikel 2, nr. 8), angives: »andet selskab i koncernen«.</p> |
| C0080 | Indirekte transaktioner | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en indirekte transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden. Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en indirekte transaktion, angives »Nej«.</p> |
| C0090 | En enkelt økonomisk transaktion | <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion er en del af en enkelt økonomisk transaktion (jf. de generelle bemærkninger ovenfor), indberettes den »Koncerninterne transaktions-ID« (C0010) for den tilknyttede transaktion i denne celle. Hvis mere end to transaktioner er tilknyttet, indberettes ID-koden for den første tilknyttede transaktion som en reference for derved at knytte alle indbyrdes forbundne transaktioner til hinanden.</p> <p>Hvis den indberettede koncerninterne transaktion ikke er en del af en enkelt økonomisk transaktion, angives »Nej«.</p> |

| POST | | VEJLEDNING |
|-------|--------------------|---|
| C0100 | Transaktionstype | Angiv typen af P&L-transaktion. Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Gebyrer 2 — Provisioner 3 — Renter 4 — Udbytter 5. Omkostninger eller indtægter 6 — Andet |
| C0110 | Transaktion | Hvis relevant det instrument, hvormed indtægten eller udgiften er forbundet Følgende udtømmende liste anvendes: 1 — Obligationer/Gæld 2 — Egenkapitaltype 3 — Anden aktivoverførsel 4 — Derivater 5 — Ikkebalanceført post 6 — Koncernintern outsourcing, intern omkostningsdeling eller lejeaftaler. 7 — Andet |
| C0120 | Transaktionsvaluta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for den valuta, hvori betalinger vedrørende den specifikke P&L-transaktion. |
| C0130 | Transaktionsdato | Angiv ISO 8601-koden (åååå-mm-dd) for den dato, hvor P&L-transaktionen påbegyndes. |
| C0140 | Beløb | Transaktionsbeløb eller -pris i henhold til aftale, i koncernens indberetningsvaluta. |
| C0150 | Bemærkninger | Bemærkningerne skal indeholde: — en meddelelse, hvis transaktionen ikke er udført på armslængdevilkår — enhver anden relevant oplysning om transaktionens økonomiske art. |

S.37.01 — Risikokoncentration — Eksponering over for modparter

Generelle bemærkninger:

Dette afsnit vedrører indberetningen af oplysninger for koncerner, der som minimum skal finde sted én gang om året.

Dette skema skal indeholde alle betydelige risikokoncentrationer mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn, og tredjeparter, som kan være summen af de risikoeksponeringer, der er nævnt i skemaet uanset valget af beregningsmetode, eller uanset om sektorbestemte solvensbestemmelser har været anvendt med henblik på beregningen af koncernsolvens.

Formålet er at anføre de betydelige eksponeringer (værdien af eksponeringer for hvert enkelt instrument, der er anført i skemaet) opdelt efter enkeltstående modpart uden for koncernen Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig.

Det kan forstås som den størst mulige eksponering i henhold til aftale og afspejles ikke nødvendigvis på balancen hverken brutto eller netto, under hensyntagen til eventuelle risikoreduktionsinstrumenter eller -teknikker. Den koncerntilsynsførende kan fastsætte tærskler efter høring af koncernen og kollegiet.

Data skal indberettes af den juridiske enhed.

| Post | | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0010 | Navn på ekstern modpart | Navnet på koncernens eksterne modpart. |
| C0020 | Identifikationskode for koncernens eksterne modpart | Den unikke identifikationskode, der er knyttet til investor/køber/erhverver, ved hjælp af denne prioriterede rækkefølge: — LEI-kode (Legal Entity Identifier) — Specifik kode Specifik kode: — For modparter uden for EØS: identifikationskode anvendt i det lokale marked, hvis en ekstern modpart er reguleret — den, som er tildelt af det eksterne selskabs kompetente tilsynsmyndighed — For modparter ikke uden for EØS: identifikationskode tildeles af koncernen Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: identifikationskode for koncernen for den eksterne modpart + ISO 3166-1 alpha-2-koden for den eksterne modparts hjemland + 5 cifre. |
| C0030 | Type identifikationskode for koncernens eksterne modpart | ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for ekstern modpart«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes: 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |

| Post | | VEJLEDNING |
|-------|---|---|
| C0045 | Navnet på koncernen (i tilfælde af en gruppe modparter) | Navnet på koncernen, hvis mere end én af de eksterne modparter hører til samme erhvervsgruppe. |
| C0080 | Vurdering | Vurdering af aktivet på referencedatoen for indberetningen udstedt af det udpegede kreditvurderingsbureau (ECAI). Hvis der foreligger to eller flere kreditvurderinger fra udpegede ECAI'er, og disse kreditvurderinger svarer til forskellige parametre for en kreditvurderet post, anvendes den vurdering, som fastsætter det højeste kapitalkrav |
| C0090 | Udpeget ECAI | Angiv det kreditvurderingsbureau (ECAI), der giver den eksterne vurdering i C0050 |
| C0100 | Sektor | Angiv den økonomiske sektor for den eksterne modpart ud fra den seneste NACE-kode (det første hierarkiniveau — bogstavet). |
| C0040 | Land | Angiv ISO 3166-1 alpha-2-koden for det land, som eksponeringen hidrører fra. For en udsteder af f.eks. en enhed angives det land, hvor udstederen af enheden har sit hovedkontor. |
| C0110 | Koncernenhed | Navnet på den enhed i koncernen, som er involveret i eksponeringerne. Den vedrører alle enheder, og enhederne indberettes hver for sig. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. |
| C0120 | Identifikationskode for koncernens enhed | <p>Selskabets identifikationskode efter følgende prioriterede rækkefølge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — LEI-kode (Legal Entity Identifier), obligatorisk, hvis den findes — Specifik kode i tilfælde af manglende LEI-kode <p>Hvis selskabet anvender muligheden »Specifik kode«, skal følgende tages i betragtning:</p> <ul style="list-style-type: none"> — For regulerede EØS-selskaber ud over forsikrings- og genforsikringsselskaber, omfattet af koncerntilsyn: identifikationskode anvendt i det lokale marked og tildelt af selskabets kompetente tilsynsmyndighed — for ikke-EØS-selskaber og ikkeregulerede selskaber omfattet af koncerntilsynet: identifikationskode tildelt af koncernen. Ved tildeling af en identifikationskode til de enkelte ikke-EØS-selskaber eller ikkeregulerede selskaber, skal koncernen konsekvent overholde følgende format: <p>identifikationskode for moderselskab + ISO 3166-1 alpha-2-koden for selskabets hjemland + 5 cifre.</p> |
| C0125 | Type identifikationskode for koncernens enhed | <p>ID-kodetype anvendt under »Identifikationskode for koncernens enhed«. En af valgmulighederne i følgende udtømmende liste anvendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — LEI-kode 2 — Specifik kode |

| Post | | VEJLEDNING |
|-------|--|---|
| C0180 | Aktier | Eksponeringer i aktieinstrumenter i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. |
| C0190 | Obligationer | Eksponeringer i obligationsinstrumenter i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. I denne celle skal der medtages de eksponeringer, for hvilke fritagelserne gælder (C0260) |
| C0200 | Aktiver, hvis risici hovedsageligt er båret af forsikringstagere | Eksponeringer i alt, hvis risici hovedsageligt er båret af forsikringstagere, over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. Se-igennem-metoden skal kun anvendes, når den er til rådighed. |
| C0210 | Derivater | Eksponeringer i derivater i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. Derivaterne indberettes med deres genanskaffelsesomkostning. Hvis der er mulighed for kompensation for de forskellige eksponeringer, kan data angives som nettoværdier (dvs. lang eksponering + kort eksponering). |
| C0220 | Øvrige investeringer | Eksponeringer i andre investeringer i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. |
| C0230 | Lån, herunder realkreditlån | Eksponeringer i lån, herunder realkreditlån, i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. |
| C0240 | Garantier og tilsagn | Eksponeringerne (dvs. den maksimale aktuelle eksponering afhængig af enhedens forpligtelse) i garantier og forpligtelser i alt (inklusive ikke betalte lånetrancher) over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. Garantier udstedt koncernenheder skal indberettes i denne kolonne, mens garantier, hvor koncernenheder er begunstigede, skal indberettes som risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer (C0260) og under indirekte eksponeringer (C0220). |
| C0250 | Forsikringspolicer | Eksponeringen i forsikringspolicerne i alt (ansvarsgrænse eller forsikringssum, afhængig af hvilken af de to, der udgør den højeste mulige eksponering). |
| C0260 | Ekstern genforsikring | Eksponeringer i ekstern genforsikring i alt over for den eksterne modpart. I overensstemmelse med sektorreglerne bør den indberettede værdi være de beløb, der kan tilbagekræves i henhold til genforsikringsaftaler. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. |
| C0270 | Andre direkte eksponeringer | Eksponeringer i andre instrumenter i alt over for den eksterne modpart. Hvis mere end én enhed i koncernen er involveret, skal hver enhed indberettes i en linje for sig. Hvis der er mulighed for kompensation, kan nettoværdien angives. |

| Post | | VEJLEDNING |
|-------|--|--|
| C0280 | Beskrivelse af »Andet« | Beskrivelse af de andre instrumenter, der er indberettet i C0200 |
| C0290 | Indirekte eksponeringer | Eksponeringer i alt, tildelt garantistilleren eller udstederen af sikkerhedsstillelsen snarere end den umiddelbare låntager. Den beskyttede oprindelige referenceeksponering (direkte eksponering) fratrækkes eksponeringen mod den oprindelige låntager i kolonnerne for »Anerkendte kreditrisikoreduktionsteknikker«. Den indirekte eksponering skal øge eksponeringen mod garantistilleren eller udstederen af sikkerhedsstillelsen via substitutionsvirkningen. |
| C0300 | Transaktioner med eksponering mod underliggende aktiver | Det samlede beløb for eksponeringen gennem transaktioner, f.eks. securitiseringspositioner eller eksponeringer over for enheder eller andele i kollektive investeringsinstitutter eller gennem andre transaktioner, hvor der findes en eksponering over for de underliggende aktiver. |
| C0160 | Valuta | Angiv ISO 4217-bogstavkoden for eksponeringens valuta. |
| C0150 | Eksponering i alt | Den samlede eksponering over for en enkeltstående modpart, hvor aktiver og forpligtelser til eller fra en enkelt modpart, modregnes for i givet fald at kunne definere den samlede maksimale nettoeksponering. Ved den samlede eksponering måles markedsbevægelser over for en enkeltstående modpart og defineres som: Lang eksponering + kort eksponering (i modsætning til en maksimal bruttoeksponering, som der ikke er anmodet om her (= lang eksponering + den absolutte værdi af kort eksponering)). Der tages ikke hensyn til risikoreduktionsinstrumenter eller -teknikker ved fastsættelsen af denne post. |
| C0310 | Risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer | Ethvert fradrag, der stammer fra anvendelsen af tilladte forsikrings- eller risikoreduktionsteknikker, som f.eks. genforsikring og anvendelse af derivater. Med hensyn til forsikringseksponeringer skal fradrag ved ikkeproportional genforsikring, der omfatter mere end en modpart, allokeres proportionalt eller som et alternativ hertil i henhold til en berettiget opdeling efter aftale med den koncerntilsynsførende. |
| C0320 | Fritagelser | Frdrag, der stammer fra anvendelsen af fritagelser i henhold til artikel 187 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| C0330 | Eksponeringer efter risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer og fritagelser | Eksponeringer efter risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer og fritagelser (netto-beløb) |

S.37.02 — Risikokoncentration — Eksponering efter valuta, sektor, land

Generelle bemærkninger:

Tabellerne skal omfatte risikokoncentrationen mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn, og tredjeparter. Alle eksponering skal angives efter valuta, sektor og land og begynde oppefra med den maksimale eksponering ned til den minimale. Hvis land, sektor eller valuta ikke er relevant, angives data under kategorien »Andet«.

»Sektor« skal angives i henhold til NACE-kodens inddelingsniveau, første niveau er et bogstav. Tabellerne er baseret på alle eksponeringer (fuldstændige balancedata) efter risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer og fritagelser (netto-beløb).

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------|---|---|
| C0010 | Valutaområde | Eksporerings valuta Eksporeringer bør indberettes i prioriteret rækkefølge med den største først. |
| C0030 | Nettoeksponering | Eksporering efter risikoreduktionsteknik ved forsikringer og fritagelser (nettobeløb). |
| C0040 | % | Eksporeringsandel af de samlede aktiver |
| C0050 | Sektor | Sektor med eksporering Eksporeringer bør indberettes i prioriteret rækkefølge med den største først. |
| C0060 | Land | Land, hvor eksporeringen befinder sig Eksporeringer bør indberettes i prioriteret rækkefølge med den største først. |
| C0070/R0010 | Den samlede nettoeksponering efter valuta | Summen af nettoeksponeringer indberettet efter valuta |
| C0070/R0020 | Den samlede nettoeksponering efter sektor | Summen af nettoeksponeringer indberettet efter sektor |
| C0070/R0030 | Den samlede nettoeksponering efter land | Summen af nettoeksponeringer indberettet efter land. |

S.37.03 — Risikokoncentration — Eksporering efter aktivklasse og vurdering

Generelle bemærkninger:

Tabellerne skal indeholde alle risikokoncentrationer mellem enheder, der er omfattet af koncerntilsyn, og tredjeparter præsenteret som en kombination af hovedaktivklasser og vurdering. For obligationer angives kombinationen af hovedaktivklasser og vurdering af sikkerhed i tabellerne. Med hensyn til aktieeksponering indberettes den samlede eksporeringsværdi og andelen af aktieeksponeringer i de samlede aktiver (fuldstændige balancedata).

Tabellen er baseret på alle eksporeringer inden for de bestemte aktivklasser, efter risikoreduktionsteknik ved kreditter eller forsikringer og fritagelser (nettobeløb).

Hvis der foreligger to eller flere kreditvurderinger fra udpegede ECA'er, og disse kreditvurderinger svarer til forskellige parametre for en kreditvurderet post, anvendes den vurdering, som fastsætter det højeste kapitalkrav

| | POST | VEJLEDNING |
|-------------------|--------------------------|--|
| C0010/R0010 | I alt — Nettoeksponering | Samlet aktieeksponering efter risikoreduktionsteknik ved forsikringer og fritagelser (nettobeløb) |
| Z0010 | Obligationstype | Inddeling i følgende obligationsklasser: 1 — Obligationer udstedt af regeringer, internationale finansielle organisationer og centralbanker 2 — Obligationer udstedt af regionale regeringer, lokale myndigheder og offentlige enheder 3 — Erhvervsobligationer |
| C0010/R0020-R0070 | Nettoeksponering | Eksporering efter risikoreduktionsteknik ved forsikringer og fritagelser (nettobeløb). |
| C0020/R0020-R0070 | % | Eksporeringsandel af de samlede aktiver |

BILAG IV

Aktivkategorier

| Kategori | | Definition: |
|----------|------------------------------------|---|
| 1 | Statsobligationer | Obligationer udstedt af offentlige myndigheder, uanset om det er centralregeringer, overstatslige regeringsinstitutioner, regionale regeringer eller lokale myndigheder, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, multilaterale udviklingsbanker omhandlet i artikel 117, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller internationale organisationer omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, regionale regeringer og lokale myndigheder, opført i artikel 1 i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, hvor garantien opfylder kravene i artikel 215 i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| 2 | Erhvervsobligationer | Obligationer udstedt af selskaber. |
| 3 | Kapitalandele | Aktier og andre værdipapirer sidestillet med aktier, der repræsenterer selskabskapitalen, dvs. ejerskabet i et selskab. |
| 4 | Kollektive investeringsinstitutter | Institut for kollektiv investering i værdipapirer (UCITS) som defineret i artikel 1, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF eller en alternativ investeringsfond (AIF) som defineret i artikel 4, stk. 1, litra a), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU. |
| 5 | Strukturerede værdipapirer | Hybride værdipapirer, der kombinerer fastforrentede værdipapirer (med afkast i form af faste betalinger) med en række derivatkomponenter. Fastforrentede værdipapirer, der er udstedt af suveræne regeringer, er ikke omfattet af denne kategori. Vedrører værdipapirer, der omfatter en kategori eller en kombination af kategorier af derivater, herunder credit default swaps (CDS'er), constant maturity swaps (CMS'er) og credit default-optioner (CDOp'er). Aktiver i denne kategori opsplittes ikke. |
| 6 | Sikrede værdipapirer | Værdipapirer, hvis værdi og betalinger er afledt af en portefølje af underliggende aktiver. Omfatter værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver (Asset Backed securities –ABS), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom (Mortgage Backed securities — MBS), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsjendom (Commercial Mortgage Backed securities — CMBS), strukturerede kreditobligationer (Collateralised Debt Obligations — CDO), collateralised loan obligations (CLO) og CMO-obligationer — collateralised mortgage obligations (CMO). Aktiver i denne kategori opsplittes ikke. |
| 7 | Konter og indskud | Penge i fysisk form, likvider, indskud i banker og andre pengeindskud. |
| 8 | Lån, herunder realkreditlån | Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer, med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools. |

| Kategori | | Definition: |
|----------|----------------------|---|
| 9 | Ejendom | Bygninger, jord, andre immobile konstruktioner samt udstyr. |
| 0 | Øvrige investeringer | Øvrige aktiver, der indberettes under »Øvrige investeringer«. |
| A | Futures | Standardiseret kontrakt mellem to parter om køb eller salg af et specifikt aktiv af standardiseret mængde og kvalitet på en fastsat fremtidig dato til en pris aftalt på datoen for kontraktindgåelsen. |
| B | Call-optioner | Kontrakt mellem to parter om køb af et aktiv til en referencepris i et fastsat tidsrum, hvor køberen af call-optionen er berettiget, men ikke forpligtet, til at købe det underliggende aktiv. |
| C | Put-optioner | Kontrakt mellem to parter om salg af et aktiv til en referencepris i et fastsat tidsrum, hvor køberen af put-optionen er berettiget, men ikke forpligtet, til at sælge det underliggende aktiv. |
| D | Swaps | Kontrakt, hvor parterne bytter visse fordele ved en parts finansielle instrument mod fordelene ved den anden parts finansielle instrument, og de pågældende fordele afhænger af typen af de finansielle instrumenter, der indgår i aftalen. |
| E | Forwards | Ikkestandardiseret kontrakt mellem to parter om køb eller salg af et aktiv på et fastsat fremtidigt tidspunkt til en pris aftalt på datoen for kontraktindgåelsen. |
| F | Kreditderivater | Derivat, hvis værdi er afledt af kreditrisikoen ved en underliggende obligation, et underliggende lån eller et andet finansielt aktiv. |

Tablet over supplerende identifikationskoder (CIC-koder)

| Første to karakterer | Aktiv noteret i | ISO 3166-1-alpha-2-landekode, XV, XL eller XT | | | | | | | | | |
|----------------------|---------------------------------|---|--------------------------|-------------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--|--|-------------------------------|----------------------|
| | | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 0 |
| Tredje karakter | Kategori | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 0 |
| | | Statsobligationer | Erhvervsobligationer | Kapitalandele | Investeringsfonde, kollektive investeringsinstitutter | Strukturrede værdipapirer | Sikrede værdipapirer | Kontanter og indskud | Lån, herunder realkreditlån | Ejendom | Øvrige investeringer |
| Fjerde karakter | Underkategori eller hovedrisiko | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | |
| | | Obligationer udstedt af centralregeringer | Erhvervsobligationer | Stamaktier | Kapitalfonde | Aktierisici | Aktierisici | Kontanter | Lån uden sikkerhedsstillelse | Ejendomme (kontor og erhverv) | |
| | | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | |
| | | Overstatslige obligationer | Konvertible obligationer | Kapitalandele i realkreditselskaber | Gældsfonde | Renterisici | Renterisici | Konverterbare indskud (likvider) | Lån med sikkerhedsstillelse i værdipapirer | Ejendomme (beboelse) | |
| | | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | | 3 | |
| | | Obligationer udstedt af regionale regeringer | Kortfristede gældsbreve | Tegningsretigheder | Pengemærkedsfonde | Valutarisici | Valutarisici | Øvrige kortfristede indskud (med en løbetid på op til ét år) | | Ejendomme (til eget brug) | |

| Første to karakterer | Aktiv noteret i | ISO 3166-1-alpha-2-landekode, XV, XL eller XT | | | | | | | | | |
|----------------------|-----------------|--|--|------------------|----------------------|---------------------------|---------------------------|---|---|---|--------|
| | | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 |
| | | Obligationer udstedt af lokale myndigheder | Pengemarkedsinstrumenter | Præferenceaktier | Specialiserede fonde | Kreditrisici | Kreditrisici | Øvrige indskud med en løbetid på over ét år | Lån, herunder realkreditlån | Ejendomme (under opførelse til investering) | |
| | | 5 | 5 | | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | |
| | | Skatkammerbeviser | Hybridobligationer | | Ejendomsfonde | Ejendomsrisici | Ejendomsrisici | Indskud til cedenter | Øvrige lån med sikkerhedsstillelse | Materielle anlægsaktiver (til eget brug) | |
| | | 6 | 6 | | 6 | 6 | 6 | | 6 | 6 | |
| | | Dækkede obligationer | Almindelige dækkede obligationer | | Alternative fonde | Råvarerisici | Råvarerisici | | Policelån | Ejendomme (under opførelse til eget brug) | |
| | | 7 | 7 | | 7 | 7 | 7 | | 7 | | |
| | | Obligationer fra nationale centralbanker | Dækkede obligationer underlagt særlig lovgivning | | Private equity-fonde | Katastrofe- og vejrrisici | Katastrofe- og vejrrisici | | Lån til medlemmer af administrations-, ledelses- eller tilsynsorganer | | |
| | | 8 | 8 | | 8 | 8 | 8 | | 8 | | |
| | | Statsobligationer, ikke denomineret i den nationale valuta | Efterstillede obligationer | | Infrastruktur-fonde | Dødelighedsrisici | Dødelighedsrisici | | Lån til andre fysiske personer | | |
| | | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| | | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige |

| Tredje karakter | Kategori | A | B | C | D | E | F |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|------------------------|
| | | Futures | Call-optioner | Put-optioner | Swaps | Forwards | Kreditderivater |
| Fjerde karakter | Underkategori eller hovedrisiko | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| | | Aktie- og indeks-futures | Aktie- og indeksop-tioner | Aktie- og indeksop-tioner | Renteswaps | Fremtidig renteaftale | Credit default swap |
| | | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| | | Rentefutures | Obligationsoptioner | Obligationsoptioner | Valutaswaps | Fremtidig veksel-kursaftale | Option på kredit-spænd |
| | | 3 | 3 | 3 | 3 | | 3 |
| | | Valutafutures | Valutaoptioner | Valutaoptioner | Rente- og valutas-waps | | Credit spread swap |
| | | | 4 | 4 | 4 | | 4 |
| | | | Warrants | Warrants | Total-afkast-swap | | Total-afkast-swap |
| | | 5 | 5 | 5 | 5 | | |
| | | Råvarefutures | Råvareoptioner | Råvareoptioner | Værdipapirswaps | | |
| | | | 6 | 6 | | | |
| | | | Swaptioner | Swaptioner | | | |
| | | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | |
| | | Katastrofe- og vejr-risici | Katastrofe- og vejr-risici | Katastrofe- og vejr-risici | Katastrofe- og vejr-risici | Katastrofe- og vejr-risici | |
| | | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | |
| | | Dødelighedsrisici | Dødelighedsrisici | Dødelighedsrisici | Dødelighedsrisici | Dødelighedsrisici | |
| | | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | Øvrige | | |

Definitioner — CIC-tabel

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|---|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| Land | ISO 3166-1-alpha-2-landekode | Angiv ISO 3166-1-alpha-2-landekoden for det land, hvor aktivet er noteret. Et aktiv anses for at være noteret, hvis det handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, som defineret i direktiv 2014/65/EU. Hvis aktivet er noteret i mere end et land, eller selskabet med henblik på værdiansættelse anvender et af de regulerede markeder eller en af de multilaterale handelsfaciliteter, hvor aktivet er noteret, til at prisfastsætte aktivet, angives landet for det marked eller den multilaterale handelsfacilitet, som anvendes til værdiansættelsen. |
| XV | Aktiver noteret i mere end et land | Angiv aktiver, der er noteret i et eller flere lande, men hvor selskabet med henblik på værdiansættelse anvender en prisfastsættelsesmekanisme, der ikke er et af de regulerede markeder eller en af de multilaterale handelsfaciliteter, hvor aktivet er noteret. |
| XL | Aktiver, der ikke er børsnoteret | Angiv aktiver, der ikke handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, som defineret i direktiv 2014/65/EU. |
| XT | Aktiver, der ikke er omsættelige på en børs | Angiv aktiver, der i kraft af deres art ikke handles på et reguleret marked eller en multilateral handelsfacilitet, som defineret i direktiv 2014/65/EU. |
| 1 | Statsobligationer | <i>Obligationer udstedt af offentlige myndigheder, uanset om det er centralregeringer, overstatslige regeringsinstitutioner, regionale regeringer eller lokale myndigheder, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, multilaterale udviklingsbanker omhandlet i artikel 117, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller internationale organisationer omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013, regionale regeringer og lokale myndigheder, opført i artikel 1 i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011, hvor garantien opfylder kravene i artikel 215 i delegeret forordning (EU) 2015/35.</i> <i>For obligationer med en garanti, der opfylder kravene, skal tredje og fjerde karakter angive den enhed, der yder garantien.</i> |
| 11 | Obligationer udstedt af centralregeringer | Obligationer udstedt af centralregeringer og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af medlemsstaternes centralregeringer, undtagen obligationer, der er denomineret og finansieret i en anden valuta end den pågældende centralregerings nationale valuta. |
| 12 | Overstatslige obligationer | Obligationer udstedt af offentlige institutioner, der er oprettet ved en aftale mellem nationalstater, f.eks. udstedt af en multilateral udviklingsbank omhandlet i artikel 117, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller udstedt af en international organisation omhandlet i artikel 118 i forordning (EU) nr. 575/2013. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|--|---|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 13 | Obligationer udstedt af regionale regeringer | Gældsinstrumenter udstedt af regionale regeringer eller selvstyrende regioner, der udbydes til offentligheden ved offentligt udbud på kapitalmarkedet, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af regionale regeringer opført på listen i artikel 1 i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011. |
| 14 | Obligationer udstedt af lokale myndigheder | Obligationer udstedt af lokale myndigheder, herunder byer, provinser, distrikter og andre kommunale myndigheder, og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af lokale myndigheder opført på listen i artikel 1 i gennemførelsesforordning (EU) 2015/2011. |
| 15 | Skatkammerbeviser | Kortfristede statsobligationer udstedt af centralregeringer (udstedt med en løbetid på op til 1 år) og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker (udstedt med en løbetid på op til 1 år). |
| 16 | Dækkede obligationer | Statsobligationer og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, som har en pulje af aktiver, der sikrer eller »dækker« obligationen. Disse aktiver forbliver på udstederens balance. |
| 17 | Nationale centralbanker | Obligationer udstedt af nationale centralbanker og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank og centralbankerne, undtagen obligationer, der er denomineret og finansieret i en anden valuta end den pågældende centralbanks nationale valuta. |
| 18 | Statsobligationer, ikke denomineret i den nationale valuta | Obligationer udstedt af centralregeringer og centralbanker denomineret og finansieret i en anden valuta end den pågældende centralregerings og centralbanks nationale valuta. |
| 19 | Øvrige | Andre statsobligationer og obligationer, der er fuldt ud, ubetinget og uigenkaldeligt garanteret af Den Europæiske Centralbank, medlemsstaternes centralregeringer og centralbanker, og som ikke er klassificeret i ovennævnte kategorier. |
| 2 | <i>Erhvervsobligationer</i> | <i>Obligationer udstedt af selskaber.</i> |
| 21 | Erhvervsobligationer | Obligationer udstedt af selskaber, med enkle egenskaber, hvilket sædvanligvis omfatter obligationer benævnt som »plain vanilla«, og som ikke har en særlig egenskab som beskrevet i kategori 22-28. |
| 22 | Konvertible obligationer | Erhvervsobligationer, som obligationsindehaver eller -udsteder kan konvertere til aktier i det udstedende selskab eller til kontanter af samme værdi, og som har gælds- eller aktielignende egenskaber. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|--|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 23 | Kortfristede gældsbreve | Usikrede, kortfristede gældsinstrumenter udstedt af et selskab, typisk til finansiering af tilgodehavender og varebeholdninger og til opfyldelsen af kortfristede forpligtelser, som regel med en oprindelig løbetid på under 270 dage. |
| 24 | Pengemarkedsinstrumenter | Meget kortfristede gældsbeviser (som regel med løbetider fra 1 dag op til 1 år), hovedsageligt bestående af omsættelige indlånsbeviser (CD'er), bankaccepter og andre meget likvide instrumenter. Kortfristede gældsbreve er ikke omfattet af denne kategori. |
| 25 | Hybridobligationer | Erhvervsobligationer, der har gælds- og aktielignende egenskaber, men som ikke er konvertible. |
| 26 | Almindelige dækkede obligationer | Erhvervsobligationer, der har en pulje af aktiver, der sikrer eller »dækker« obligationen. Disse aktiver forbliver på udstederens balance. Dækkede obligationer underlagt særlig lovgivning er ikke omfattet af denne kategori. |
| 27 | Dækkede obligationer underlagt særlig lovgivning | Erhvervsobligationer, der har en pulje af aktiver, der sikrer eller »dækker« obligationen, hvis den eksponeringsleverende virksomhed bliver insolvent, og i henhold til lovgivning er underkastet et særligt offentligt tilsyn med henblik på at beskytte indehaverne af obligationerne, som fastsat i artikel 52, stk. 4, i direktiv 2009/65/EF. Som eksempel herpå kan nævnes Pfandbrief: »Dækkede obligationer, der er udstedt på grundlag af den tyske lov om Pfandbriefe. De anvendes til at refinansiere lån, for hvilke der stilles sikkerhed i form af lån sikret ved pant i fast ejendom (Hypothekenpfandbriefe), lån i den offentlige sektor (Öffentliche Pfandbriefe), skibspant (Schiffspfandbriefe) eller flypant (Flugzeugpfandbriefe). Sondringen mellem disse typer Pfandbrief foretages altså efter den dækningspulje, der findes for hver type Pfandbrief.« |
| 28 | Efterstillede obligationer | Erhvervsobligationer, der har lavere prioritet end andre obligationer fra udstederen i tilfælde af likvidation. |
| 29 | Øvrige | Øvrige erhvervsobligationer med andre egenskaber end dem, der er angivet i ovennævnte kategorier. |
| 3 | Kapitalandele | Aktier og andre værdipapirer sidestillet med aktier, der repræsenterer selskabskapitalen, f.eks. ejerskabet i et selskab. |
| 31 | Stamaktier | Kapitalandele, der repræsenterer grundlæggende ejendomsrettigheder til selskaber. |
| 32 | Kapitalandele i realkreditselskaber | Kapitalandele, der repræsenterer kapital i realkreditselskaber. |
| 33 | Tegningsrettigheder | Rettigheder til at tegne yderligere kapitalandele til en fast kurs. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|------------------------------------|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 34 | Præferenceaktier | Kapitalandele, der har forrang for stamaktier, idet de har en større fordring på aktiverne og indtægterne end stamaktier, men som er efterstillet obligationer. |
| 39 | Øvrige | Øvrige kapitalandele, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 4 | Kollektive investeringsinstitutter | <i>Ved kollektive investeringsinstitutter forstås et institut for kollektiv investering i omsættelige værdipapirer (UCITS) som defineret i artikel 1, stk. 2, i direktiv 2009/65/EF eller en alternativ investeringsfond (AIF) som defineret i artikel 4, stk. 1, litra a), i direktiv 2011/61/EU.</i> |
| 41 | Kapitalfonde | Kollektive investeringsinstitutter, der hovedsageligt har investeringer i kapitalandele. |
| 42 | Gældsfonde | Kollektive investeringsinstitutter, der hovedsageligt har investeringer i obligationer. |
| 43 | Pengemarkedsfonde | Kollektive investeringsinstitutter, der falder ind under ESMA's definition (CESR/10-049). |
| 44 | Specialiserede fonde | Kollektive investeringsinstitutter, der investerer deres aktiver i henhold til et specifikt mål for aktivallokeringen, f.eks. ved hovedsageligt at investere i værdipapirer fra selskaber i lande med nye aktiemarkeder eller små økonomier, specifikke sektorer eller grupper af sektorer, specifikke lande eller andre specifikke investeringsmål. |
| 45 | Ejendomsfonde | Kollektive investeringsinstitutter, der hovedsageligt har investeringer i fast ejendom. |
| 46 | Alternative fonde | Kollektive investeringsinstitutter, hvis investeringsstrategier f.eks. omfatter hedging, hændelsesbaserede strategier, fixed income directional and relative value (FI-RV), futures under forvaltning, råvarer osv. |
| 47 | Private equity-fonde | Kollektive investeringsinstitutter, der anvendes til at foretage investeringer i kapitalandele i henhold til strategier forbundet med private equity. |
| 48 | Infrastrukturfonde | Kollektive investeringsinstitutter, der investerer i infrastrukturaktiver som defineret i artikel 1, nr. 55a eller 55b, i delegeret forordning (EU) 2015/35. |
| 49 | Øvrige | Øvrige kollektive investeringsinstitutter, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 5 | Strukturerede værdipapirer | <i>Hybride værdipapirer, der kombinerer fastforrentede værdipapirer (med afkast i form af faste betalinger) med en række derivatkomponenter. Fastforrentede værdipapirer, der er udstedt af suveræne regeringer, er ikke omfattet af denne kategori. Vedrører værdipapirer, der omfatter en kategori eller en kombination af kategorier af derivater, herunder credit default swaps (CDS'er), constant maturity swaps (CMS'er) og credit default-optioner (CDOp'er). Aktiver i denne kategori opsplittes ikke.</i> |
| 51 | Aktierisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod aktierisici. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|-----------------------------|---|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 52 | Renterisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod renterisici. |
| 53 | Valutarisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod valutarisici. |
| 54 | Kreditrisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod kreditrisici. |
| 55 | Ejendomsrisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod ejendomsrisici. |
| 56 | Råvarerisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod råvarerisici. |
| 57 | Katastrofe- og vejrrisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| 58 | Dødelighedsrisici | Strukturerede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| 59 | Øvrige | Øvrige strukturerede værdipapirer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 6 | <i>Sikrede værdipapirer</i> | <i>Værdipapirer, hvis værdi og betalinger er afledt af en portefølje af underliggende aktiver. Omfatter værdipapirer med sikkerhedsstillelse i aktiver (Asset Backed securities –ABS), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i fast ejendom (Mortgage Backed securities — MBS), værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsjendom (Commercial Mortgage Backed securities — CMBS), strukturerede kreditobligationer (Collateralised Debt Obligations — CDO), collateralised loan obligations (CLO) og CMO-obligationer — collateralised mortgage obligations (CMO). Aktiver i denne kategori opsplittes ikke.</i> |
| 61 | Aktierisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod aktierisici. |
| 62 | Renterisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod renterisici. |
| 63 | Valutarisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod valutarisici. |
| 64 | Kreditrisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod kreditrisici. |
| 65 | Ejendomsrisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod ejendomsrisici. |
| 66 | Råvarerisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod råvarerisici. |
| 67 | Katastrofe- og vejrrisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|--|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 68 | Dødelighedsrisici | Sikrede værdipapirer hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| 69 | Øvrige | Øvrige sikrede værdipapirer, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 7 | <i>Kontanter og indskud</i> | <i>Penge i fysisk form, likvider, indskud i banker og andre pengeindskud.</i> |
| 71 | Kontanter | Pengesedler og mønter i omløb, som normalt anvendes til betalinger. |
| 72 | Konverterbare indskud (likvider) | Indskud, der på anfordring kan konverteres til kontanter til pari, og som er direkte anvendelige til at foretage betalinger ved check, anvisning, girokort, direkte debitering/kreditering eller lignende direkte betalingsfacilitet uden sanktioner eller begrænsninger. |
| 73 | Øvrige kortfristede indskud (med en løbetid på op til ét år) | Andre indskud end transferable indskud, med en restløbetid på op til 1 år, som ikke kan anvendes til at foretage betalinger på et hvilket som helst tidspunkt, og som ikke kan konverteres til kontanter, eller transferable indskud uden væsentlige begrænsninger eller sanktioner. |
| 74 | Øvrige indskud med en løbetid på over ét år | Andre indskud end transferable indskud, med en restløbetid på over 1 år, som ikke kan anvendes til at foretage betalinger på et hvilket som helst tidspunkt, og som ikke kan konverteres til kontanter, eller transferable indskud uden væsentlige begrænsninger eller sanktioner. |
| 75 | Indskud til cedenter | Indskud vedrørende accepteret genforsikring. |
| 79 | Øvrige | Øvrige kontanter og indskud, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 8 | <i>Lån, herunder realkreditlån</i> | <i>Finansielle aktiver, som skabes, når kreditorer låner midler til debitorer, med eller uden sikkerhedsstillelse, herunder cash pools.</i> |
| 81 | Lån uden sikkerhedsstillelse | Lån ydet uden sikkerhedsstillelse. |
| 82 | Lån med sikkerhedsstillelse i værdipapirer | Lån ydet mod sikkerhedsstillelse i værdipapirer. |
| 84 | Lån, herunder realkreditlån | Lån, herunder realkreditlån, ydet mod sikkerhedsstillelse i fast ejendom. |
| 85 | Øvrige lån med sikkerhedsstillelse | Lån ydet mod sikkerhedsstillelse i andre former. |
| 86 | Policelån | Lån ydet mod sikkerhedsstillelse i forsikringspolicer. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|---|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| 87 | Lån til medlemmer af administrations-, ledelses- eller tilsynsorganer | Lån til medlemmer af administrations-, ledelses- eller tilsynsorganer. Denne kategori har forrang frem for de ovennævnte. |
| 88 | Lån til andre fysiske personer | Lån ydet til andre fysiske personer. Denne kategori har forrang frem for de ovennævnte. |
| 89 | Øvrige | Øvrige lån, herunder realkreditlån, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 9 | <i>Ejendom</i> | <i>Bygninger, jord, andre immobile konstruktioner samt udstyr.</i> |
| 91 | Ejendomme (kontor og erhverv) | Kontor- og erhvervsejendomme anvendt til investering. |
| 92 | Ejendomme (beboelse) | Beboelsesejendomme anvendt til investering. |
| 93 | Ejendomme (til eget brug) | Ejendomme til selskabets eget brug. |
| 94 | Ejendomme (under opførelse til investering) | Ejendomme, der er under opførelse, til fremtidig brug som investering. |
| 95 | Materielle anlægsaktiver (til eget brug) | Materielle anlægsaktiver til selskabets eget brug. |
| 96 | Ejendomme (under opførelse til eget brug) | Ejendomme, der er under opførelse, til fremtidig eget brug. |
| 99 | Øvrige | Øvrig ejendom, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| 0 | Øvrige investeringer | Øvrige aktiver, der indberettes under »Øvrige investeringer«. |
| 09 | Øvrige investeringer | Øvrige aktiver, der indberettes under »Øvrige investeringer«. |
| A | <i>Futures</i> | <i>Standardiseret kontrakt mellem to parter om køb eller salg af et specifikt aktiv af standardiseret mængde og kvalitet på en fastsat fremtidig dato til en pris aftalt på datoen for kontraktindgåelsen.</i> |
| A1 | Aktie- og indeksfutures | Futures med aktier eller børsindeks som underliggende aktiv. |
| A2 | Rentefutures | Futures med obligationer eller andre renteaftængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| A3 | Valutafutures | Futures med valutaer eller andre valutaafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|---------------------------|---|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| A5 | Råvarefutures | Futures med råvarer eller andre råvareafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| A7 | Katastrofe- og vejrrisici | Futures hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| A8 | Dødelighedsrisici | Futures hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| A9 | Øvrige | Øvrige futures, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| B | <i>Call-optioner</i> | <i>Kontrakt mellem to parter om køb af et aktiv til en referencepris i et fastsat tidsrum, hvor køberen af call-optionen er berettiget, men ikke forpligtet, til at købe det underliggende aktiv.</i> |
| B1 | Aktie- og indeksoptioner | Call-optioner med aktier eller børsindeks som underliggende aktiv. |
| B2 | Obligationsoptioner | Call-optioner med obligationer eller andre renteafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| B3 | Valutaoptioner | Call-optioner med valutaer eller andre valutaafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| B4 | Warrants | Call-optioner, der giver indehaveren ret til at tegne aktier i det udstedende selskab til en fastsat kurs. |
| B5 | Råvareoptioner | Call-optioner med råvarer eller andre råvareafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| B6 | Swaptioner | Call-optioner, der giver indehaveren ret, men ikke pligt, til at indtræde i en lang position i en underliggende swap, dvs. indtræde i en swap, hvor indehaveren betaler det faste rentebænk og modtager det variable rentebænk. |
| B7 | Katastrofe- og vejrrisici | Call-optioner hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| B8 | Dødelighedsrisici | Call-optioner hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| B9 | Øvrige | Øvrige call-optioner, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| C | <i>Put-optioner</i> | <i>Kontrakt mellem to parter om salg af et aktiv til en referencepris i et fastsat tidsrum, hvor køberen af put-optionen er berettiget, men ikke forpligtet, til at sælge det underliggende aktiv.</i> |
| C1 | Aktie- og indeksoptioner | Put-optioner med aktier eller børsindeks som underliggende aktiv. |
| C2 | Obligationsoptioner | Put-optioner med obligationer eller andre renteafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| C3 | Valutaoptioner | Put-optioner med valutaer eller andre valutaafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|---------------------------|--|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| C4 | Warrants | Put-optioner, der giver indehaveren ret til at sælge aktier i det udstedende selskab til en fastsat kurs. |
| C5 | Råvareoptioner | Put-optioner med råvarer eller andre råvareafhængige værdipapirer som underliggende aktiv. |
| C6 | Swaptioner | Put-optioner, der giver indehaveren ret, men ikke pligt, til at indtræde i en kort position i en underliggende swap, dvs. indtræde i en swap, hvor indehaveren modtager det faste renteben og betaler det variable renteben. |
| C7 | Katastrofe- og vejrrisici | Put-optioner hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| C8 | Dødelighedsrisici | Put-optioner hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| C9 | Øvrige | Øvrige put-optioner, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| D | Swaps | <i>Kontrakt, hvor parterne bytter visse fordele ved en parts finansielle instrument mod fordelene ved den anden parts finansielle instrument, og de pågældende fordele afhænger af typen af de finansielle instrumenter, der indgår i aftalen.</i> |
| D1 | Renteswaps | Swap, der udveksler rentestrømme. |
| D2 | Valutaswaps | Swap, der udveksler valuta. |
| D3 | Rente- og valutaswaps | Swap, der udveksler rente- og valutastrømme. |
| D4 | Total-afkast-swap | Swap, hvor det ikke-variabelt forrentede renteben er baseret på det totale afkast af en kapitalandel eller et fast forrentet instrument med en løbetid, der er længere end swappen. |
| D5 | Værdipapirswaps | Swap, der udveksler værdipapirer. |
| D7 | Katastrofe- og vejrrisici | Swaps hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| D8 | Dødelighedsrisici | Swaps hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| D9 | Øvrige | Øvrige swaps, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |

| Første to karakterer — Aktiver noteret i | | Definition |
|--|----------------------------|---|
| Tredje og fjerde karakter — Kategori | | Definition |
| E | Forwards | <i>Ikkestandardiseret kontrakt mellem to parter om køb eller salg af et aktiv på et fastsat fremtidigt tidspunkt til en pris aftalt på datoen for kontraktindgåelsen.</i> |
| E1 | Fremtidig renteaftale | Forwardkontrakt, hvor en part typisk betaler en fast rente og modtager en variabel rente, der sædvanligvis er baseret på en underliggende indekssats, på den fastsatte fremtidige dato. |
| E2 | Fremtidig vekselkursaftale | Forwardkontrakt, hvor en part betaler et beløb i én valuta og modtager et tilsvarende beløb i en anden valuta, som fremkommer ved konvertering i henhold til den aftalte vekselkurs, på den fastsatte fremtidige dato. |
| E7 | Katastrofe- og vejrrisici | Forwards hovedsageligt eksponeret mod katastrofe- og vejrrisici. |
| E8 | Dødelighedsrisici | Forwards hovedsageligt eksponeret mod dødelighedsrisici. |
| E9 | Øvrige | Øvrige forwards, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |
| F | Kreditderivater | <i>Derivat, hvis værdi er afledt af kreditrisikoen ved en underliggende obligation, et underliggende lån eller et andet finansielt aktiv.</i> |
| F1 | Credit default swap | Kreditderivattransaktion, hvor to parter indgår en aftale, hvorved den ene part betaler den anden en fast periodisk kuponrente i den fastsatte løbetid for aftalen, og den anden part ingen betalinger foretager, medmindre en kreditbegivenhed, der vedrører et forudbestemt referenceaktiv, indtræffer. |
| F2 | Option på kreditspænd | Kreditderivat, der genererer cash flows, hvis et givet kreditspænd mellem to bestemte aktiver eller benchmarks ændres fra sit aktuelle niveau. |
| F3 | Credit spread swap | Swap, hvor en part foretager en fast betaling til den anden på swappens afregningsdato, og den anden part betaler den første et beløb baseret på det faktiske kreditspænd. |
| F4 | Total-afkast-swap | Swap, hvor det ikke-variabelt forrentede renteben er baseret på det totale afkast af en kapitalandel eller et fast forrentet instrument med en løbetid, der er længere end swappen. |
| F9 | Øvrige | Øvrige kreditderivater, der ikke er klassificeret under ovennævnte kategorier. |