

Anhang I
S.02.01.02
Bilanz

Name der Gruppe: **R+V Versicherung AG Versicherungsgruppe**
 RegNr. **6960**
 Werte in TEUR

Vermögenswerte

Immaterielle Vermögenswerte

Latente Steueransprüche

Überschuss bei den Altersversorgungsleistungen

Immobilien, Sachanlagen und Vorräte für den Eigenbedarf

Anlagen (außer Vermögenswerten für indexgebundene und fondsgebundene Verträge)

Immobilien (außer zur Eigennutzung)

Anteile an verbundenen Unternehmen, einschließlich Beteiligungen

Aktien

Aktien – notiert

Aktien – nicht notiert

Anleihen

Staatsanleihen

Unternehmensanleihen

Strukturierte Schuldtitel

Besicherte Wertpapiere

Organismen für gemeinsame Anlagen

Derivate

Einlagen außer Zahlungsmitteläquivalenten

Sonstige Anlagen

Vermögenswerte für index- und fondsgebundene Verträge

Darlehen und Hypotheken

Policendarlehen

Darlehen und Hypotheken an Privatpersonen

Sonstige Darlehen und Hypotheken

Einforderbare Beträge aus Rückversicherungsverträgen von:

Nichtlebensversicherungen und nach Art der Nichtlebensversicherung betriebenen

Krankenversicherungen

Nichtlebensversicherungen außer Krankenversicherungen

nach Art der Nichtlebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen

Lebensversicherungen und nach Art der Lebensversicherung betriebenen

Krankenversicherungen außer Krankenversicherungen und fonds- und

indexgebundenen Versicherungen

nach Art der Lebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen

Lebensversicherungen außer Krankenversicherungen und fonds- und

indexgebundenen Versicherungen

Lebensversicherungen, fonds- und indexgebunden

Depotforderungen

Forderungen gegenüber Versicherungen und Vermittlern

Forderungen gegenüber Rückversicherern

Forderungen (Handel, nicht Versicherung)

Eigene Anteile (direkt gehalten)

In Bezug auf Eigenmittelbestandteile fällige Beträge oder ursprünglich eingeforderte, aber

noch nicht eingezahlte Mittel

Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Sonstige nicht an anderer Stelle ausgewiesene Vermögenswerte

Vermögenswerte insgesamt

	Solvabilität-II-Wert
	C0010
R0030	
R0040	
R0050	1.302
R0060	697.333
R0070	98.705.782
R0080	3.124.107
R0090	3.854.368
R0100	619.808
R0110	171.107
R0120	448.701
R0130	51.070.425
R0140	16.071.782
R0150	29.890.711
R0160	3.768.111
R0170	1.339.821
R0180	37.628.939
R0190	1.560.355
R0200	847.781
R0210	
R0220	12.511.235
R0230	12.482.184
R0240	43.253
R0250	11.363.181
R0260	1.075.750
R0270	-35.024
R0280	25.621
R0290	22.307
R0300	3.314
R0310	-60.643
R0320	-46.180
R0330	-14.463
R0340	-2
R0350	574.778
R0360	336.215
R0370	16.187
R0380	1.176.232
R0390	6.089
R0400	
R0410	1.330.130
R0420	668.863
R0500	128.471.306

	Solvabilität-II-Wert	
	C0010	
Verbindlichkeiten		
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung	R0510	12.577.476
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung (außer Krankenversicherung)		
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0520	12.165.556
Bester Schätzwert	R0530	
Risikomarge	R0540	10.575.398
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Nichtlebensversicherung)	R0550	1.590.158
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0560	411.921
Bester Schätzwert	R0570	
Risikomarge	R0580	371.574
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (außer fonds- und indexgebundenen Versicherungen)	R0590	40.347
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Lebensversicherung)	R0600	80.937.033
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0610	5.077.763
Bester Schätzwert	R0620	
Risikomarge	R0630	4.826.084
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (außer Krankenversicherungen und fonds- und indexgebundenen Versicherungen)	R0640	251.679
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0650	75.859.270
Bester Schätzwert	R0660	
Risikomarge	R0670	75.371.896
Versicherungstechnische Rückstellungen – fonds- und indexgebundene Versicherungen	R0680	487.374
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0690	11.142.481
Bester Schätzwert	R0700	
Risikomarge	R0710	10.307.963
Eventualverbindlichkeiten	R0720	834.518
Andere Rückstellungen als versicherungstechnische Rückstellungen	R0740	
Rentenzahlungsverpflichtungen	R0750	309.160
Depotverbindlichkeiten	R0760	225.583
Latente Steuerschulden	R0770	40.812
Derivate	R0780	3.484.178
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	R0790	428.638
Finanzielle Verbindlichkeiten außer Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	R0800	605.720
Verbindlichkeiten gegenüber Versicherungen und Vermittlern	R0810	1.948.639
Verbindlichkeiten gegenüber Rückversicherern	R0820	169.986
Verbindlichkeiten (Handel, nicht Versicherung)	R0830	48.073
Nachrangige Verbindlichkeiten	R0840	29.024
Nicht in den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkeiten	R0850	28.700
In den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkeiten	R0860	
Sonstige nicht an anderer Stelle ausgewiesene Verbindlichkeiten	R0870	28.700
Verbindlichkeiten insgesamt	R0880	35.249
Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten	R0900	112.010.754
	R1000	16.460.552

Anhang I

S.22.01.22

Werte in TEUR

Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen

		Betrag mit langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen	Auswirkung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Auswirkung der Übergangsmaßnahme bei Zinssätzen	Auswirkung einer Verringerung der Volatilitätsanpassung auf null	Auswirkung einer Verringerung der Matching-Anpassung auf null
		C0010	C0030	C0050	C0070	C0090
Versicherungstechnische Rückstellungen	R0010	104.656.991	4.424.684		50.857	
Basiseigenmittel	R0020	14.940.404	-3.122.493		124.490	
Für die Erfüllung der SCR anrechnungsfähige Eigenmittel	R0050	15.161.110	-3.122.493		124.490	
SCR	R0090	8.295.330	382.220		132.168	

Ergänzende Eigenmittel

Nicht eingezahltes und nicht eingefordertes Grundkapital, das auf Verlangen eingefordert werden kann
 Gründungsstock, Mitgliederbeiträge oder entsprechender Basiseigenmittelbestandteil bei Versicherungsvereinen auf
 Gegenseitigkeit und diesen ähnlichen Unternehmen, die nicht eingezahlt und nicht eingefordert wurden, aber auf Verlangen
 eingefordert werden können

Nicht eingezahlte und nicht eingeforderte Vorzugsaktien, die auf Verlangen eingefordert werden können
 Eine rechtsverbindliche Verpflichtung, auf Verlangen nachrangige Verbindlichkeiten zu zeichnen und zu begleichen
 Kreditbriefe und Garantien gemäß Artikel 96 Absatz 2 der Richtlinie 2009/138/EG

Andere Kreditbriefe und Garantien als solche nach Artikel 96 Absatz 2 der Richtlinie 2009/138/EG

Aufforderungen an die Mitglieder zur Nachzahlung gemäß Artikel 96 Absatz 3 Unterabsatz 1 der Richtlinie 2009/138/EG

Aufforderungen an die Mitglieder zur Nachzahlung – andere als solche gemäß Artikel 96 Absatz 3 Unterabsatz 1 der Richtlinie

Nicht verfügbare ergänzende Eigenmittel auf Gruppenebene

Sonstige ergänzende Eigenmittel

Ergänzende Eigenmittel gesamt

Eigenmittel anderer Finanzbranchen

Kreditinstitute, Wertpapierfirmen, Finanzinstitute, Verwalter alternativer Investmentfonds, OGAW Verwaltungsgesellschaften -
 insgesamt

Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung

Nicht der Aufsicht unterliegende Unternehmen, die Finanzgeschäfte tätigen

Gesamtbetrag der Eigenmittel anderer Finanzbranchen

Eigenmittel bei Verwendung der Abzugs- und Aggregationsmethode, ausschließlich oder in Kombination mit Methode 1

Gesamtbetrag der Eigenmittel bei Verwendung der Abzugs- und Aggregationsmethode oder einer Kombination der Methoden

Gesamtbetrag der Eigenmittel bei Verwendung der Abzugs- und Aggregationsmethode oder einer Kombination der Methoden

Gesamtbetrag der für die Erfüllung der konsolidierten SCR für die Gruppe zur Verfügung stehenden Eigenmittel (außer
 Eigenmitteln aus anderen Finanzbranchen und aus den durch die Abzugs- und Aggregationsmethode einbezogenen
 Unternehmen)

Gesamtbetrag der für die Erfüllung des Mindestbetrags der konsolidierten SCR für die Gruppe zur Verfügung stehenden
 Eigenmittel

Gesamtbetrag der für die Erfüllung der konsolidierten SCR für die Gruppe anrechnungsfähigen Eigenmittel (außer Eigenmitteln
 aus anderen Finanzbranchen und aus den durch die Abzugs- und Aggregationsmethode einbezogenen Unternehmen)

Gesamtbetrag der für die Erfüllung des Mindestbetrags der konsolidierten SCR für die Gruppe anrechnungsfähigen Eigenmittel

Mindestbetrag der konsolidierten SCR für die Gruppe (Artikel 230)

Verhältnis von anrechnungsfähigen Eigenmitteln zum Mindestbetrag der konsolidierten SCR für die Gruppe

R0300					
R0310					
R0320					
R0330					
R0340					
R0350					
R0360					
R0370					
R0380					
R0390					
R0400					
R0410	3.664	3.664			
R0420	217.042	217.042			
R0430					
R0440	220.706	220.706			
R0450					
R0460					
R0520	14.940.404	14.924.704	500	15.200	
R0530	14.940.404	14.924.704	500	15.200	
R0560	14.940.404	14.924.704	500	15.200	
R0570	14.940.404	14.924.704	500	15.200	
R0610	3.220.068				
R0650	4,6398				

Gesamtbetrag der für die Erfüllung der SCR für die Gruppe anrechnungsfähigen Eigenmittel (einschließlich Eigenmitteln aus anderen Finanzbranchen und aus den durch die Abzugs- und Aggregationsmethode einbezogenen Unternehmen)

SCR für die Gruppe

Verhältnis von anrechnungsfähigen Eigenmitteln zur SCR für die Gruppe, einschließlich Eigenmitteln aus anderen Finanzbranchen und aus den durch die Abzugs- und Aggregationsmethode einbezogenen Unternehmen

R0660	15.161.110	15.145.410	500	15.200	
R0680	8.295.330				
R0690	1,8277				

Ausgleichsrücklage

Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten

Eigene Anteile (direkt und indirekt gehalten)

Vorhersehbare Dividenden, Ausschüttungen und Entgelte

Sonstige Basiseigenmittelbestandteile

Anpassung für gebundene Eigenmittelbestandteile in Matching-Adjustment-Portfolios und Sonderverbänden

Sonstige nicht verfügbare Eigenmittel

Ausgleichsrücklage vor Abzug von Beteiligungen in anderen Finanzbranchen

Erwartete Gewinne

Bei künftigen Prämien einkalkulierter erwarteter Gewinn (EPIFP) – Lebensversicherung

Bei künftigen Prämien einkalkulierter erwarteter Gewinn (EPIFP) – Nichtlebensversicherung

EPIFP gesamt

	C0060				
R0700	16.460.552				
R0710	6.089				
R0720					
R0730	4.546.335				
R0740					
R0750					
R0760	11.908.129				
R0770	1,021,449				
R0780	559.762				
R0790	1,581,211				

Anhang I
S.25.01.22

Solvenzkapitalanforderung – für Gruppen, die die Standardformel verwenden

Werte in TEUR

Marktrisiko
 Gegenparteiausfallrisiko
 Lebensversicherungstechnisches Risiko
 Krankenversicherungstechnisches Risiko
 Nichtlebensversicherungstechnisches Risiko
 Diversifikation
 Risiko immaterieller Vermögenswerte

Basissolvenzkapitalanforderung

Berechnung der Solvenzkapitalanforderung

Operationelles Risiko
 Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen
 Verlustausgleichsfähigkeit der latenten Steuern
 Kapitalanforderung für Geschäfte nach Artikel 4 der Richtlinie 2003/41/EG

Solvenzkapitalanforderung ohne Kapitalaufschlag

Kapitalaufschlag bereits festgesetzt

Solvenzkapitalanforderung

Weitere Angaben zur SCR

Kapitalanforderung für das durationsbasierte Untermodul Aktienrisiko
 Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderungen für den übrigen Teil
 Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderungen für Sonderverbände
 Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderungen für Matching-Adjustment-Portfolios
 Diversifikationseffekte aufgrund der Aggregation der fiktiven Solvenzkapitalanforderung für Sonderverbände nach Artikel 304
 Mindestbetrag der konsolidierten Solvenzkapitalanforderung für die Gruppe

Angaben über andere Unternehmen

Kapitalanforderung für andere Finanzbranchen (versicherungsfremde Kapitalanforderungen)
 Kapitalanforderung für andere Finanzbranchen (versicherungsfremde Kapitalanforderungen) – Kreditinstitute, Wertpapierfirmen, Finanzinstitute, Verwalter alternativer Investmentfonds und OGAW-Verwaltungsgesellschaften
 Kapitalanforderung für andere Finanzbranchen (versicherungsfremde Kapitalanforderungen) – Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung
 Kapitalanforderung für andere Finanzbranchen (versicherungsfremde Kapitalanforderungen) – Kapitalanforderung für nicht der Aufsicht unterliegende Unternehmen, die Finanzgeschäfte tätigen
 Kapitalanforderung bei Beteiligung an Unternehmen, auf die maßgeblicher Einfluss ausgeübt wird
 Kapitalanforderung für verbleibende Unternehmen

Gesamt-SCR

SCR für Unternehmen, die durch die Abzugs- und Aggregationsmethode einbezogen werden

Solvenzkapitalanforderung

	Brutto- Solvenzkapitalanforderung	USP	Vereinfachungen
	C0110	C0090	C0120
R0010	11.828.752		
R0020	261.483		
R0030	3.124.098		Sterblichkeitsrisiko,
R0040	2.340.796		Nichtlebensversiche
R0050	6.684.767		Stornorisiko
R0060	-7.523.550		
R0070			
R0100	16.716.346		

	C0100
R0130	693.906
R0140	-7.406.518
R0150	-1.834.034
R0160	
R0200	8.169.700
R0210	
R0220	8.295.330
R0400	
R0410	
R0420	
R0430	
R0440	
R0470	3.220.068
R0500	125.630
R0510	1.545
R0520	124.085
R0530	
R0540	
R0550	
R0560	
R0570	8.295.330

