

**Anhang I**

**S.02.01.02  
Bilanz**

**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**

**Name des VU:** Condor Lebensversicherungs-  
Aktiengesellschaft

**RegNr.:** 1021

**Werte in TEUR**

	<b>Solvabilität-II-Wert</b>
	<b>C0010</b>
<b>R0030</b>	
<b>R0040</b>	21.256
<b>R0050</b>	
<b>R0060</b>	
<b>R0070</b>	3.818.735
<b>R0080</b>	65.907
<b>R0090</b>	67.015
<b>R0100</b>	16.465
<b>R0110</b>	14.894
<b>R0120</b>	1.571
<b>R0130</b>	1.902.727
<b>R0140</b>	565.052
<b>R0150</b>	1.159.292
<b>R0160</b>	124.647
<b>R0170</b>	53.737
<b>R0180</b>	1.723.255
<b>R0190</b>	43.367
<b>R0200</b>	
<b>R0210</b>	
<b>R0220</b>	1.225.375
<b>R0230</b>	33.173
<b>R0240</b>	4.980
<b>R0250</b>	13.097
<b>R0260</b>	15.096
<b>R0270</b>	-2.944
<b>R0280</b>	
<b>R0290</b>	
<b>R0300</b>	
<b>R0310</b>	-2.943
<b>R0320</b>	-2.548
<b>R0330</b>	-395
<b>R0340</b>	-1
<b>R0350</b>	
<b>R0360</b>	4.427
<b>R0370</b>	
<b>R0380</b>	30.620
<b>R0390</b>	
<b>R0400</b>	
<b>R0410</b>	5.539
<b>R0420</b>	21.073
<b>R0500</b>	5.157.254

	<b>Solvabilität-II-Wert</b>
	<b>C0010</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung (außer Krankenversicherung)	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	
Bester Schätzwert	
Risikomarge	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Nichtlebensversicherung)	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	
Bester Schätzwert	
Risikomarge	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (außer fonds- und indexgebundenen Versicherungen)	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Lebensversicherung)	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	
Bester Schätzwert	
Risikomarge	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (außer Krankenversicherungen und fonds- und indexgebundenen Versicherungen)	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	
Bester Schätzwert	
Risikomarge	
Versicherungstechnische Rückstellungen – fonds- und indexgebundene Versicherungen	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	
Bester Schätzwert	
Risikomarge	
Eventualverbindlichkeiten	
Andere Rückstellungen als versicherungstechnische Rückstellungen	
Rentenzahlungsverpflichtungen	
Depotverbindlichkeiten	
Latente Steuerschulden	
Derivate	
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	
Finanzielle Verbindlichkeiten außer Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	
Verbindlichkeiten gegenüber Versicherungen und Vermittlern	
Verbindlichkeiten gegenüber Rückversicherern	
Verbindlichkeiten (Handel, nicht Versicherung)	
Nachrangige Verbindlichkeiten	
Nicht in den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkeiten	
In den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkeiten	
Sonstige nicht an anderer Stelle ausgewiesene Verbindlichkeiten	
<b>Verbindlichkeiten insgesamt</b>	
<b>Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten</b>	
<b>R0510</b>	
<b>R0520</b>	
<b>R0530</b>	
<b>R0540</b>	
<b>R0550</b>	
<b>R0560</b>	
<b>R0570</b>	
<b>R0580</b>	
<b>R0590</b>	
<b>R0600</b>	3.505.986
<b>R0610</b>	84.869
<b>R0620</b>	
<b>R0630</b>	84.263
<b>R0640</b>	606
<b>R0650</b>	3.421.117
<b>R0660</b>	
<b>R0670</b>	3.416.007
<b>R0680</b>	5.111
<b>R0690</b>	1.111.734
<b>R0700</b>	
<b>R0710</b>	1.106.802
<b>R0720</b>	4.932
<b>R0740</b>	
<b>R0750</b>	538
<b>R0760</b>	5.740
<b>R0770</b>	4.186
<b>R0780</b>	87.159
<b>R0790</b>	16.390
<b>R0800</b>	
<b>R0810</b>	88.702
<b>R0820</b>	
<b>R0830</b>	
<b>R0840</b>	6
<b>R0850</b>	
<b>R0860</b>	
<b>R0870</b>	
<b>R0880</b>	107
<b>R0900</b>	4.820.549
<b>R1000</b>	336.705



Versicherungstechnische Rückstellungen in der Lebensversicherung und in der nach Art der Lebensversicherung betriebenen Krankenversicherung

	Versicherung mit Überschuss- beteiligung	Index- und fondsgebundene Versicherung		Sonstige Lebensversicherung		Renten aus Nichtlebens- versicherungs- verträgen und im Zusammenhang mit anderen Versicherungs- verpflichtungen (mit Ausnahme von Kranken- versicherungs- verpflichtungen)	In Rückdeckung übernommenes Geschäft	Gesamt (Lebens- versicherung außer Kranken- versicherung, einschl. fondsgebundenes Geschäft)
		C0030	Verträge ohne Optionen und Garantien C0040	Verträge mit Optionen oder Garantien C0050	C0060			
<b>Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet</b>	<b>R0010</b>							
Gesamthöhe der einforderebaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen nach der Anpassung für erwartete Verluste aufgrund von Gegenparteiausfällen bei versicherungstechnischen Rückstellungen als Ganzes berechnet	<b>R0020</b>							
<b>Versicherungstechnische Rückstellungen berechnet als Summe aus bestem Schätzwert und Risikomarge</b>								
<b>Bester Schätzwert</b>								
<b>Bester Schätzwert (brutto)</b>	<b>R0030</b>	3.703.092		1.119.541		41		4.822.674
Gesamthöhe der einforderebaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen nach der Anpassung für erwartete Verluste aufgrund von Gegenparteiausfällen	<b>R0080</b>	-395		-1				-396
Bester Schätzwert abzüglich der einforderebaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen – gesamt	<b>R0090</b>	3.703.488		1.119.541		41		4.823.070
<b>Risikomarge</b>	<b>R0100</b>	33.654	6.678		1			40.332
<b>Betrag bei Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen</b>								
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	<b>R0110</b>							
Bester Schätzwert	<b>R0120</b>	-287.124		-12.739		-2		-299.865
Risikomarge	<b>R0130</b>	-28.544	-1.745					-30.289
<b>Versicherungstechnische Rückstellungen – gesamt</b>	<b>R0200</b>	3.421.079	1.111.734		39			4.532.852

**Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet**  
Gesamthöhe der einfordbaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen nach der Anpassung für erwartete Verluste aufgrund von Gegenparteausfällen bei versicherungstechnischen Rückstellungen als Ganzes berechnet

**Beste Schätzwert**  
**Beste Schätzwert (brutto)**

Gesamthöhe der einfordbaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen nach der Anpassung für erwartete Verluste aufgrund von Gegenparteausfällen

Beste Schätzwert abzüglich der einfordbaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen – gesamt

**Risikomarge**

**Betrag bei Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen**

Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet

Beste Schätzwert

Risikomarge

**Versicherungstechnische Rückstellungen – gesamt**

Krankenversicherung (Direktversicherungsgeschäft)			Renten aus Nichtlebensversicherungsverträgen und im Zusammenhang mit Krankenversicherungsverpflichtungen	Krankenrückversicherung (in Rückdeckung übernommenes Geschäft)	Gesamt (Krankenversicherung nach Art der Lebensversicherung)	
	Verträge ohne Optionen und Garantien	Verträge mit Optionen oder Garantien				
	C0160	C0170	C0180	C0190	C0200	C0210
<b>R0010</b>						
<b>R0020</b>						
<b>R0030</b>			9.409			9.409
<b>R0080</b>			-2.548			-2.548
<b>R0090</b>			11.957			11.957
<b>R0100</b>	606					606
<b>R0110</b>						
<b>R0120</b>			74.854			74.854
<b>R0130</b>						
<b>R0200</b>	84.869					84.869

## Anhang I

S.22.01.21

## Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen

Werte in TEUR

		Betrag mit langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen	Auswirkung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Auswirkung der Übergangsmaßnah me bei Zinssätzen	Auswirkung einer Verringerung der Volatilitätsanpassung auf null	Auswirkung einer Verringerung der Matching-Anpassung auf null
		C0010	C0030	C0050	C0070	C0090
Versicherungstechnische Rückstellungen	<b>R0010</b>	4.617.720	255.301		-19	
Basiseigenmittel	<b>R0020</b>	336.705	-180.335		-37	
Für die Erfüllung der SCR anrechnungsfähige Eigenmittel	<b>R0050</b>	336.705	-180.335		-37	
SCR	<b>R0090</b>	36.061	17.649		588	
Für die Erfüllung der MCR anrechnungsfähige Eigenmittel	<b>R0100</b>	336.705	-180.335		-37	
Mindestkapitalanforderung	<b>R0110</b>	16.228	7.942		265	



**Anhang I**

**S.25.01.21**

**Solvenzkapitalanforderung – für Unternehmen, die die Standardformel verwenden**

Werte in TEUR

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

	<b>Brutto- Solvenzkapitalanforderung</b>	<b>USP</b>	<b>Vereinfachungen</b>
	<b>C0110</b>	<b>C0090</b>	<b>C0120</b>
<b>R0010</b>	532.848		
<b>R0020</b>	3.923		
<b>R0030</b>	141.567		Stornorisiko
<b>R0040</b>	178.292		Stornorisiko Kranken nach Art der Leben
<b>R0050</b>			
<b>R0060</b>	-196.871		
<b>R0070</b>			
<b>R0100</b>	659.759		

**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 Solvenzkapitalanforderung 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

	<b>C0100</b>
<b>R0130</b>	16.338
<b>R0140</b>	-623.343
<b>R0150</b>	-16.693
<b>R0160</b>	
<b>R0200</b>	36.061
<b>R0210</b>	
<b>R0220</b>	36.061
<b>R0400</b>	
<b>R0410</b>	
<b>R0420</b>	
<b>R0430</b>	
<b>R0440</b>	

**Annäherung an den Steuersatz**

Ansatz auf Basis des durchschnittlichen Steuersatzes

	<b>Ja/Nein</b>
	<b>C0109</b>
<b>R0590</b>	Approach based on average tax rate

**Berechnung der Verlustausgleichsfähigkeit der latenten Steuern**

VAF LS  
 VAF LS gerechtfertigt durch die Umkehrung der passiven latenten Steuern  
 VAF LS gerechtfertigt durch Bezugnahme auf den wahrscheinlichen zukünftigen zu versteuernden wirtschaftlichen Gewinn  
 VAF LS gerechtfertigt durch Rücktrag, laufendes Jahr  
 VAF LS gerechtfertigt durch Rücktrag, zukünftige Jahre  
 Maximum VAF LS

	<b>VAF LS</b>
	<b>C0130</b>
<b>R0640</b>	-16.693
<b>R0650</b>	-16.693
<b>R0660</b>	
<b>R0670</b>	
<b>R0680</b>	
<b>R0690</b>	-16.693



Mindestkapitalanforderung – nur Lebensversicherungs- oder nur Nichtlebensversicherungs- oder Rückversicherungstätigkeit

Bestandteil der linearen Formel für Nichtlebensversicherungs- und Rückversicherungsverpflichtungen

MCR <sub>NL</sub> -Ergebnis	C0010		Bester Schätzwert (nach Abzug der Rückversicherung/ Zweckgesellschaft) und versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	Gebuchte Prämien (nach Abzug der Rückversicherung) in den letzten zwölf Monaten
	R0010			
Krankheitskostenversicherung und proportionale Rückversicherung			R0020	
Einkommensersatzversicherung und proportionale Rückversicherung			R0030	
Arbeitsunfallversicherung und proportionale Rückversicherung			R0040	
Kraftfahrzeughaftpflichtversicherung und proportionale Rückversicherung			R0050	
Sonstige Kraftfahrtversicherung und proportionale Rückversicherung			R0060	
See-, Luftfahrt- und Transportversicherung und proportionale Rückversicherung			R0070	
Feuer- und andere Sachversicherungen und proportionale Rückversicherung			R0080	
Allgemeine Haftpflichtversicherung und proportionale Rückversicherung			R0090	
Kredit- und Kautionsversicherung und proportionale Rückversicherung			R0100	
Rechtsschutzversicherung und proportionale Rückversicherung			R0110	
Beistand und proportionale Rückversicherung			R0120	
Versicherung gegen verschiedene finanzielle Verluste und proportionale Rückversicherung			R0130	
Nichtproportionale Krankenrückversicherung			R0140	
Nichtproportionale Unfallrückversicherung			R0150	
Nichtproportionale See-, Luftfahrt- und Transportrückversicherung			R0160	
Nichtproportionale Sachrückversicherung			R0170	

Bestandteil der linearen Formel für Lebensversicherungs- und Rückversicherungsverpflichtungen

MCR <sub>L</sub> -Ergebnis	C0040		Bester Schätzwert (nach Abzug der Rückversicherung/ Zweckgesellschaft) und versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	Gesamtes Risikokapital (nach Abzug der Rückversicherung/ Zweckgesellschaft)
	R0200	35.463		
Verpflichtungen mit Überschussbeteiligung – garantierte Leistungen			R0210	2.438.697
Verpflichtungen mit Überschussbeteiligung – künftige Überschussbeteiligungen			R0220	1.275.312
Verpflichtungen aus index- und fondsgebundenen Versicherungen			R0230	1.107.380
Sonstige Verpflichtungen aus Lebens(rück)- und Kranken(rück)versicherungen			R0240	39
Gesamtes Risikokapital für alle Lebens(rück)versicherungsverpflichtungen			R0250	5.421.006

Berechnung der Gesamt-MCR

	C0070		
Lineare MCR	R0300	35.463	
SCR	R0310	36.061	
MCR-Obergrenze	R0320	16.228	
MCR-Untergrenze	R0330	9.015	
Kombinierte MCR	R0340	16.228	
Absolute Untergrenze der MCR	R0350	3.700	
		C0070	
Mindestkapitalanforderung	R0400	16.228	