

**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

**Verbindlichkeiten**

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  
**Verbindlichkeiten insgesamt**  
**Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten**

	<b>Solvabilität-II-Wert</b>
	<b>C0010</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)		
		C0020	C0030	Verträge ohne Optionen und Garantien C0040	Verträge mit Optionen oder Garantien C0050				C0060	Verträge ohne Optionen und Garantien C0070
<b>Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet</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>Versicherungstechnische Rückstellungen berechnet als Summe aus bestem Schätzwert und Risikomarge</b>										
<b>Bester Schätzwert</b>										
<b>Bester Schätzwert (brutto)</b>	R0030	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	R0080	-395		-1						-396
Bester Schätzwert abzüglich der einforderebaren Beträge aus Rückversicherungsverträgen/gegenüber Zweckgesellschaften und Finanzrückversicherungen – gesamt	R0090	3.703.488		1.119.541		41				4.823.070
<b>Risikomarge</b>	R0100	33.654	6.678		1					40.332
<b>Betrag bei Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen</b>										
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0110									
Bester Schätzwert	R0120	-287.124		-12.739		-2				-299.865
Risikomarge	R0130	-28.544	-1.745							-30.289
<b>Versicherungstechnische Rückstellungen – gesamt</b>	R0200	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				
Einkommensersatzversicherung und proportionale Rückversicherung				
Arbeitsunfallversicherung und proportionale Rückversicherung				
Kraftfahrzeughaftpflichtversicherung und proportionale Rückversicherung				
Sonstige Kraftfahrtversicherung und proportionale Rückversicherung				
See-, Luftfahrt- und Transportversicherung und proportionale Rückversicherung				
Feuer- und andere Sachversicherungen und proportionale Rückversicherung				
Allgemeine Haftpflichtversicherung und proportionale Rückversicherung				
Kredit- und Kautionsversicherung und proportionale Rückversicherung				
Rechtsschutzversicherung und proportionale Rückversicherung				
Beistand und proportionale Rückversicherung				
Versicherung gegen verschiedene finanzielle Verluste und proportionale Rückversicherung				
Nichtproportionale Krankenrückversicherung				
Nichtproportionale Unfallrückversicherung				
Nichtproportionale See-, Luftfahrt- und Transportrückversicherung				
Nichtproportionale Sachrückversicherung				

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			2.438.697	
Verpflichtungen mit Überschussbeteiligung – künftige Überschussbeteiligungen			1.275.312	
Verpflichtungen aus index- und fondsgebundenen Versicherungen			1.107.380	
Sonstige Verpflichtungen aus Lebens(rück)- und Kranken(rück)versicherungen			39	
Gesamtes Risikokapital für alle Lebens(rück)versicherungsverpflichtungen				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