

Bericht über die Finanzlage: Quantitative Vorlage "Marktnahe Bilanz Solo"

Währung: CHFm
Angaben in Millionen

| | | Stichtag Vorperiode | Anpassungen Vorperiode | Stichtag Berichtsjahr |
|---|---|------------------------|---------------------------|--------------------------|
| Marktnaher Wert der Kapitalanlagen | Immobilien | | - | |
| | Beteiligungen | | - | |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | 255.1 | - | 267.7 |
| | Darlehen | | - | |
| | Hypotheken | | - | |
| | Aktien | | - | |
| | Übrige Kapitalanlagen | | - | |
| | Kollektive Kapitalanlagen | 27.7 | - | 27.3 |
| | Alternative Kapitalanlagen | | - | |
| | Sonstige Kapitalanlagen | | - | |
| | Total Kapitalanlagen | 282.8 | - | 295.0 |
| Finanzanlagen aus anteilgebundener Lebensversicherung | | - | | |
| Forderungen aus derivativen Finanzinstrumenten | | - | | |
| Marktnaher Wert der übrigen Aktiven | Flüssige Mittel | 13.8 | - | 24.0 |
| | Forderungen aus dem Versicherungsgeschäft | 21.6 | - | 28.0 |
| | Übrige Forderungen | 26.9 | - | 6.2 |
| | Sonstige Aktiven | 2.6 | - | 2.7 |
| | Total übrige Aktiven | 64.9 | - | 60.8 |
| Total marktnaher Wert der Aktiven | Total marktnaher Wert der Aktiven | 347.7 | - | 355.9 |

| | | | | |
|---|---|--------------|----------|--------------|
| Bestmöglicher Schätzwert der Versicherungs-verpflichtungen (BEL) | Bestmöglicher Schätzwert der Rückstellungen für Versicherungsverpflichtungen | 269.7 | - | 266.0 |
| | Direktversicherung: Lebensversicherungsgeschäft (ohne ALV) | | - | |
| | Direktversicherung: Schadenversicherungsgeschäft | 225.2 | - | 230.1 |
| | Direktversicherung: Krankenversicherungsgeschäft | | - | |
| | Direktversicherung: Anteilgebundenes Lebensversicherungsgeschäft | | - | |
| | Direktversicherung: Sonstiges Geschäft | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Lebensversicherungsgeschäft (ohne ALV) | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Schadenversicherungsgeschäft | 44.5 | - | 35.9 |
| | Aktive Rückversicherung: Krankenversicherungsgeschäft | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Anteilgebundenes Lebensversicherungsgeschäft | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Sonstiges Geschäft | | - | |
| | Anteile Rückversicherer am bestmöglichen Schätzwert der Rückstellungen für Versicherungsverpflichtungen | -158.7 | - | -162.3 |
| | Direktversicherung: Lebensversicherungsgeschäft (ohne ALV) | | - | |
| | Direktversicherung: Schadenversicherungsgeschäft | -125.0 | - | -135.4 |
| | Direktversicherung: Krankenversicherungsgeschäft | | - | |
| | Direktversicherung: Anteilgebundenes Lebensversicherungsgeschäft | | - | |
| | Direktversicherung: Sonstiges Geschäft | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Lebensversicherungsgeschäft (ohne ALV) | | - | |
| | Aktive Rückversicherung: Schadenversicherungsgeschäft | -33.7 | - | -26.9 |
| | Aktive Rückversicherung: Krankenversicherungsgeschäft | | - | |
| Aktive Rückversicherung: Anteilgebundenes Lebensversicherungsgeschäft | | - | | |
| Aktive Rückversicherung: Sonstiges Geschäft | | - | | |
| Marktnaher Wert der übrigen Verpflichtungen | Nicht versicherungstechnische Rückstellungen | - | - | - |
| | Verzinsliche Verbindlichkeiten | 15.2 | - | - |
| | Verpflichtungen aus derivativen Finanzinstrumenten | | - | |
| | Depotverbindlichkeiten aus abgegebener Rückversicherung | | - | |
| | Verbindlichkeiten aus dem Versicherungsgeschäft | 9.5 | - | 10.5 |
| | Sonstige Passiven | 11.5 | - | 15.3 |
| Summe aus BEL plus marktnaher Wert der übrigen Verpflichtungen | Summe aus BEL plus marktnaher Wert der übrigen Verpflichtungen | 147.2 | - | 129.4 |

| | | | | |
|--|---|--------------|----------|--------------|
| | Differenz marktnaher Wert der Aktiven abzüglich der Summe aus BEL plus marktnaher Wert der übrigen Verbindlichkeiten | 200.5 | - | 226.5 |
|--|---|--------------|----------|--------------|

**Bericht über die Finanzlage: Quantitative Vorlage
"Solvabilität Solo"**

Währung: CHF
Angaben in Millionen

| | | Stichtag Vorperiode | Anpassungen Vorperiode | Stichtag Berichtsjahr |
|-----------------------|--|---------------------|------------------------|-----------------------|
| | | in Mio. CHF | in Mio. CHF | in Mio. CHF |
| Herleitung RTK | Differenz marktnaher Wert der Aktiven abzüglich der Summe aus bestmöglichem Schätzwert der Versicherungsverpflichtungen plus Marktnaher Wert der übrigen Verpflichtungen | | | |
| | Abzüge | 200.5 | | 226.5 |
| | Kernkapital | - | | - |
| | Ergänzendes Kapital | 200.5 | | 226.5 |
| | RTK | - | | - |
| | | 200.5 | - | 226.5 |

| | | Stichtag Vorperiode | Anpassungen Vorperiode | Stichtag Berichtsjahr |
|-------------------------------|---|---------------------|------------------------|-----------------------|
| | | in Mio. CHF | in Mio. CHF | in Mio. CHF |
| Herleitung Zielkapital | Versicherungstechnisches Risiko | 43.0 | | 47.3 |
| | Marktrisiko | 23.8 | | 25.2 |
| | Diversifikationseffekte | -14.6 | | -15.7 |
| | Kreditrisiko | 8.3 | | 9.7 |
| | Mindestbetrag und sonstige Effekte auf das ZK | 2.9 | | -0.7 |
| | Zielkapital | 63.3 | - | 65.8 |

| | | Stichtag Vorperiode | Anpassungen Vorperiode | Stichtag Berichtsjahr |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------|------------------------|-----------------------|
| | | in % | in % | in % |
| SST-Quotient | Risikotragendes Kapital / Zielkapital | 352% | 0% | 393% |