



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 6. Oktober 2015
(OR. en)

12782/15
ADD 1

EF 186
ECOFIN 753
SURE 26
DELECT 130

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag der Generalsekretärin der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	1. Oktober 2015
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2015) 6588 final - ANNEXES 1 to 3
Betr.:	ANHÄNGE zur Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission zur Änderung der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission in Bezug auf die Berechnung der gesetzlichen Kapitalanforderungen für verschiedene von Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen gehaltene Anlageklassen

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2015) 6588 final - ANNEXES 1 to 3.

Anl.: C(2015) 6588 final - ANNEXES 1 to 3



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 30.9.2015
C(2015) 6588 final

ANNEXES 1 to 3

ANHÄNGE

zur

Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission

zur Änderung der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission in Bezug auf die Berechnung der gesetzlichen Kapitalanforderungen für verschiedene von Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen gehaltene Anlageklassen

ANHANG I

Anhang XVII der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission wird wie folgt geändert:

(1) Teil B wird wie folgt geändert:

(a) Nummer 2 Buchstabe c erhält folgende Fassung:

„c) wird die Prämienrisikomethode angewandt, um die in Artikel 218 Absatz 1 Buchstabe a Ziffer ii und Buchstabe c Ziffer ii genannten Standardparameter zu ersetzen, sind die aggregierten Schäden und verdienten Prämien nicht um die aus Rückversicherungsverträgen und von Zweckgesellschaften einforderbaren Beträge oder Rückversicherungsprämien zu bereinigen;“.

(b) Nummer 2 Buchstabe d Satz 1 erhält folgende Fassung:

„wird die Methode für das Prämienrisiko angewandt, um die in Artikel 218 Absatz 1 Buchstabe a Ziffer i und Buchstabe c Ziffer i genannten Parameter zu ersetzen,“.

(2) In Teil D Nummer 5 erhalten Satz 1 und Formel 1 folgende Fassung:

„Der mittlere quadratische Vorhersagefehler errechnet sich wie folgt:

$$MSEP = \sum_{i=1}^I \hat{C}_{(i,J)}^2 \cdot \left(\frac{\hat{Q}_{I-i}}{C_{(i,I-i)}} + \frac{\hat{Q}_{I-i}}{S_{I-i}} + \sum_{j=I-i+1}^{J-1} \frac{C_{(I-j,j)}}{S'_j} \cdot \frac{\hat{Q}_j}{S_j} \right) + 2 \cdot \sum_{i=1}^I \sum_{k=i+1}^I \hat{C}_{(i,J)} \cdot \hat{C}_{(k,J)} \cdot \left(\frac{\hat{Q}_{I-i}}{S_{I-i}} + \sum_{j=I-i+1}^{J-1} \frac{C_{(I-j,j)}}{S'_j} \cdot \frac{\hat{Q}_j}{S_j} \right)$$

“

(3) Teil F Nummer 3 Buchstabe f erhält folgende Fassung:

„f) sieht der anerkennungsfähige Schadenexzendenten-Rückversicherungsvertrag nach Artikel 218 Absatz 2 eine Erstattung nur bis zu einer festgelegten Obergrenze vor, so bezeichnet b2 den Betrag dieser Obergrenze.“

ANHANG II

Anhang XVIII der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission wird wie folgt geändert:

(1) Teil C Nummer 2 Buchstabe b Satz 1 erhält folgende Fassung:

„sie müssen sämtliche nachfolgend genannten Untermodule der Standardformel umfassen, mit Ausnahme derjenigen, die in den Anwendungsbereich des internen Partialmodells fallen.“

(2) Teil C Nummer 2 Buchstabe c erhält folgende Fassung:

„c) sie müssen das Gegenparteiausfallrisikomodul der Standardformel umfassen, sofern es nicht in den Anwendungsbereich des internen Partialmodells fällt.“

ANHANG III

Anhang XXI der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission wird wie folgt geändert:

(1) Teil A letzter Satz erhält folgende Fassung:

„Die Angaben der Absätze 1 bis 32 sind mit dem Stand vom Ende des vergangenen Kalenderjahrs zu erteilen. Die Angaben der Absätze 12 bis 21, 23, 24 und 29 bis 31 müssen sich auf das jeweilige Ende des Geschäftsjahres der Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen bzw. Versicherungsgruppen beziehen, das im vergangenen Kalenderjahr endete.“

(2) Teil B letzter Satz erhält folgende Fassung:

„Die Angaben der Absätze 2 bis 18 sind in Bezug auf das vergangene Kalenderjahr zu erteilen.“