



RAPPORT SUR LA SOLVABILITE ET LA SITUATION FINANCIERE

Annexe F.1

Groupe Le Conservateur

Résultats au 31.12.2023

Présenté au Conseil de surveillance du 28.03.2024

F.1.1 Déclarations quantitatives Groupe

F.1.1.1a Groupe / SII / QRT S.32.01.22 - Entreprises entrant dans le périmètre du groupe partie 1

| | Pays | Code d'identification de l'entreprise | Type de code d'identification de l'entreprise | Nom juridique de l'entreprise | Type d'entreprise | Forme juridique | Catégorie (mutuelle/non mutuelle) | Autorité de contrôle |
|---|--------|---------------------------------------|---|--|--|----------------------------------|-----------------------------------|--|
| | Co010 | Co020 | Co030 | Co040 | Co050 | Co060 | Co070 | Co080 |
| 1 | France | 969500HKAYZDEBVK | 1 – LEI | Les Assurances Mutuelles Le Conservateur | 1 – Entreprise d'assurance vie | Société d'assurance mutuelle | 1 – Mutuelle | Autorité de contrôle prudentiel et de résolution |
| 2 | France | 969500TWN9AO9K7D | 1 – LEI | Les Associations Mutuelles Le Conservateur | 1 – Entreprise d'assurance vie | Société d'assurance mutuelle | 1 – Mutuelle | Autorité de contrôle prudentiel et de résolution |
| 3 | France | 9695007F3XAONPDW | 1 – LEI | Conservateur Finance | 8 – Établissement de crédit, entreprise d'assurance | Société anonyme | 2 – Non mutuelle | Autorité de contrôle prudentiel et de résolution |
| 4 | France | 331 997 430 | 2 – Code spécifique | SCI Le Conservateur | 10 – Entreprise de services auxiliaires au secteur financier | Société civile immobilière | 2 – Non mutuelle | |
| 5 | France | 405 007 964 | 2 – Code spécifique | Conservateur Patrimoine | 10 – Entreprise de services auxiliaires au secteur financier | Société à responsabilité limitée | 2 – Non mutuelle | |
| 6 | France | 981 897 689 | 2 – Code spécifique | Conservateur Assurances Immobilières | 10 – Entreprise de services auxiliaires au secteur financier | Société par actions simplifiée | 2 – Non mutuelle | |

F.1.1.1b Groupe / SII / QRT S.32.01.22 - Entreprises entrant dans le périmètre du groupe partie 2

| | Critères d'influence | | | | | | Inclusion dans le contrôle de groupe | | Calcul de solvabilité du groupe |
|---|----------------------|---|----------------------|-----------------|-------------------|--|--------------------------------------|---|--|
| | % de part de capital | % utilisé pour l'établissement des comptes consolidés | % des droits de vote | Autres critères | Degré d'influence | Part proportionnelle utilisée pour le calcul de la solvabilité du groupe | OUI/NON | Date de la décision si l'article 214 s'applique | Méthode utilisée et, en cas d'utilisation de la première méthode, traitement de l'entreprise |
| | Co180 | Co190 | Co200 | Co210 | Co220 | Co230 | Co240 | Co250 | Co260 |
| 1 | | 100 | 100 | | 1 – Dominante | 100 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 1 – Première méthode: consolidation intégrale |
| 2 | | 100 | 100 | | 1 – Dominante | 100 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 1 – Première méthode: consolidation intégrale |
| 3 | 80 | 100 | 80 | | 1 – Dominante | 80 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 4 – Première méthode: règles sectorielles |
| 4 | 100 | 100 | 100 | | 1 – Dominante | 100 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 3 – Première méthode: méthode de la mise en équivalence corrigée |
| 5 | 100 | 100 | 100 | | 1 – Dominante | 100 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 3 – Première méthode: méthode de la mise en équivalence corrigée |
| 6 | 100 | 100 | 100 | | 1 – Dominante | 100 | 1 | Incluse dans le contrôle du groupe | 3 – Première méthode: méthode de la mise en équivalence corrigée |

F.1.1.2a Groupe / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Actifs

| | | C0010 |
|---|--------------|--------------|
| Actifs | | |
| Immobilisations incorporelles | R0030 | 0 |
| Actifs d'impôts différés | R0040 | 0 |
| Excédents du régime de retraite | R0050 | 0 |
| Immobilisations corporelles détenues pour usage propre | R0060 | 46 843 |
| Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés) | R0070 | 2 663 998 |
| Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre) | R0080 | 110 097 |
| Détentions dans des entreprises liées, y compris participations | R0090 | 0 |
| Actions | R0100 | 416 |
| Actions - cotées | R0110 | 0 |
| Actions - non cotées | R0120 | 416 |
| Obligations | R0130 | 2 064 815 |
| Obligations d'État | R0140 | 601 579 |
| Obligations d'entreprise | R0150 | 1 398 972 |
| Titres structurés | R0160 | 64 265 |
| Titres garantis | R0170 | 0 |
| Organismes de placement collectif | R0180 | 438 285 |
| Produits dérivés | R0190 | 0 |
| Dépôts autres que les équivalents de trésorerie | R0200 | 50 385 |
| Autres investissements | R0210 | 0 |
| Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés | R0220 | 7 024 388 |
| Prêts et prêts hypothécaires | R0230 | 21 713 |
| Avances sur police | R0240 | 21 707 |
| Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers | R0250 | 6 |
| Autres prêts et prêts hypothécaires | R0260 | 0 |
| Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance | R0270 | -4 150 |
| Non-vie et santé similaire à la non-vie | R0280 | 0 |

| | | C0010 |
|--|--------------|-------------------|
| Non-vie hors santé | R0290 | 0 |
| Santé similaire à la non-vie | R0300 | 0 |
| Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés | R0310 | -4 150 |
| Santé similaire à la vie | R0320 | 0 |
| Vie hors santé, UC et indexés | R0330 | -4 150 |
| Vie UC et indexés | R0340 | 0 |
| Dépôts auprès des cédantes | R0350 | 0 |
| Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires | R0360 | 8 492 |
| Créances nées d'opérations de réassurance | R0370 | 591 |
| Autres créances (hors assurance) | R0380 | 59 331 |
| Actions propres auto-détenues (directement) | R0390 | 0 |
| Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s) | R0400 | 0 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | R0410 | 244 465 |
| Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus | R0420 | 22 |
| Total de l'actif | R0500 | 10 065 692 |

F.1.1.2b Groupe / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Passifs

| | | C0010 |
|---|--------------|-----------|
| Passifs | | |
| Provisions techniques non-vie | R0510 | 0 |
| Provisions techniques non-vie | R0520 | 0 |
| Provisions techniques ca | R0530 | 0 |
| Meilleure estimation | R0540 | 0 |
| Marge de risque | R0550 | 0 |
| Provisions techniques santé (si) | R0560 | 0 |
| Provisions techniques ca | R0570 | 0 |
| Meilleure estimation | R0580 | 0 |
| Marge de risque | R0590 | 0 |
| Provisions techniques vie (hors UC et | R0600 | 2 610 505 |
| Provisions techniques santé (si) | R0610 | 0 |
| Provisions techniques ca | R0620 | 0 |
| Meilleure estimation | R0630 | 0 |
| Marge de risque | R0640 | 0 |
| Provisions techniques vie (hors santé, UC et indexés) | R0650 | 2 610 505 |
| Provisions techniques ca | R0660 | 106 375 |
| Meilleure estimation | R0670 | 2 493 720 |
| Marge de risque | R0680 | 10 409 |
| Provisions techniques UC et indexés | R0690 | 7 040 767 |
| Provisions techniques calculées | R0700 | 0 |
| Meilleure estimation | R0710 | 6 988 625 |

F.1.1.4 Groupe / SII / QRT S.05.02.01 - Primes, sinistres et dépenses par pays

Sans objet car la totalité des primes est comptabilisée sur la France.

F.1.1.5 Groupe / SII / QRT S.22.01.22 - Mesures transitoires

| | | Montant avec mesures relatives aux garanties de long terme et mesures transitoires | Impact des mesures transitoires sur les provisions techniques | Impact des mesures transitoires sur les taux d'intérêt | Impact d'une correction pour volatilité fixée à zéro | Impact d'un ajustement égalisateur fixé à zéro |
|---|--------------|--|---|---|--|---|
| | | C0010 | C0030 | C0050 | C0070 | C0090 |
| Provisions techniques | R0010 | 9 651 272 | | | 5 589 | |
| Fonds propres de base | R0020 | 328 863 | | | -7 008 | |
| Fonds propres éligibles pour couvrir le | R0050 | 311 161 | | | -7 268 | |
| Capital de solvabilité requis | R0090 | 134 645 | | | -2 867 | |

F.1.1.6.1 Groupe / SII / QRT S.23.01.22 - Fonds propres

| | | Total | Niveau 1 – non restreint | Niveau 1 – restreint | Niveau 2 | Niveau 3 |
|--|--------------|--------|--------------------------|----------------------|----------|----------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Fonds propres de base avant déduction pour participations dans d'autres secteurs financiers | | | | | | |
| Capital en actions ordinaires (brut des actions propres) | R0010 | | | | | |
| Capital en actions ordinaires appelé non versé non disponible au niveau du groupe | R0020 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires | R0030 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalent pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0040 | 5 182 | 5 182 | | | |
| Comptes mutualistes subordonnés | R0050 | | | | | |
| Comptes mutualistes subordonnés non disponibles au niveau du groupe | R0060 | | | | | |
| Fonds excédentaires | R0070 | 50 514 | 50 514 | | | |
| Fonds excédentaires non disponibles au niveau du groupe | R0080 | | | | | |
| Actions de préférence | R0090 | | | | | |
| Actions de préférence non disponibles au niveau du groupe | R0100 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence | R0110 | | | | | |

| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
|---|-------|---------|---------|-------|-------|-------|
| Comptes de primes d'émission liés aux actions de préférence, non disponibles au niveau du groupe | R0120 | | | | | |
| Réserve de réconciliation | R0130 | 267 197 | 267 197 | | | |
| Passifs subordonnés | R0140 | | | | | |
| Passifs subordonnés non disponibles au niveau du groupe | R0150 | | | | | |
| Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets | R0160 | | | | | |
| Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets non disponibles au niveau du groupe | R0170 | | | | | |
| Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra | R0180 | | | | | |

| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
|---|-------|---------|---------|-------|-------|-------|
| Fonds propres non disponibles relatifs à d'autres éléments de fonds propres approuvés par une autorité de contrôle | R0190 | 16 657 | 16 657 | | | |
| Intérêts minoritaires (non déclarés dans le cadre d'un autre élément de fonds propres) | R0200 | | | | | |
| Intérêts minoritaires non disponibles au niveau du groupe | R0210 | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | R0220 | 1 045 | | | | |
| Déductions | | | | | | |
| Déductions pour participations dans d'autres entreprises financières, y compris des entreprises non réglementées exerçant des activités financières | R0230 | 5 970 | 5 970 | | | |
| dont déduites conformément à l'article 228 de la directive 2009/138/CE | R0240 | | | | | |
| Déductions pour les participations lorsque les informations sont indisponibles (article 229) | R0250 | | | | | |
| Déduction pour les participations incluses par déduction et agrégation lorsqu'une combinaison de méthodes est utilisée | R0260 | | | | | |
| Total des éléments de fonds propres non disponibles | R0270 | 16 657 | 16 657 | | | |
| Total déductions | R0280 | 22 627 | 22 627 | | | |
| Total fonds propres de base après déductions | R0290 | 311 161 | 311 161 | | | |
| Fonds propres auxiliaires | | | | | | |

| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande | R0300 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalents, non libérés, non appelés et appelables sur demande, pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0310 | | | | | |
| Actions de préférence non libérées et non appelées, appelables sur demande | R0320 | | | | | |
| Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande | R0330 | | | | | |

| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
|--|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0340 | | | | | |
| Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0350 | | | | | |
| Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE | R0360 | | | | | |
| Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE | R0370 | | | | | |
| Fonds propres auxiliaires non disponibles au niveau du groupe | R0380 | | | | | |
| Autres fonds propres auxiliaires | R0390 | | | | | |
| Total fonds propres auxiliaires | R0400 | | | | | |
| Fonds propres d'autres secteurs financiers | | | | | | |
| Réserve de réconciliation | R0410 | 5 970 | 5 970 | | | |
| Institution de retraite professionnelle | R0420 | | | | | |
| Entités non réglementées exerçant des activités financières | R0430 | | | | | |
| Total fonds propres d'autres secteurs financiers | R0440 | 5 970 | 5 970 | | | |
| Fonds propres en cas de recours à la méthode de déduction agrégation, soit exclusivement, soit combinée à la première méthode | | | | | | |
| Fonds propres agrégés en cas d'utilisation de la déduction et agrégation ou d'une combinaison des méthodes | R0450 | | | | | |

| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
|---|-------|---------|-------|-------|-------|-------|
| Fonds propres agrégés en cas d'utilisation de la déduction et agrégation ou d'une combinaison des méthodes nets des transactions intragroupe | R0460 | | | | | |
| | | | | | | |
| Total des fonds propres disponibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée (à l'exclusion des fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation) | R0520 | 305 191 | | | | |
| Total des fonds propres disponibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée | R0530 | 305 191 | | | | |
| Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée (à l'exclusion des fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation) | R0560 | 305 191 | | | | |
| Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée | R0570 | 305 191 | | | | |
| Minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée | R0610 | 60 829 | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée | R0650 | 502% | | | | |
| Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) | R0660 | 311 161 | | | | |
| Capital de solvabilité requis du groupe | R0680 | 134 645 | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis du groupe (y compris autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) | R0690 | 231% | | | | |

F.1.1.6.2 Groupe / SII / QRT S.23.01.22 - Réserve de réconciliation

| | | C0060 | | | | |
|---|--------------|----------------|--|--|--|--|
| Réserve de réconciliation | | | | | | |
| Excédent d'actif sur passif | R0700 | 328 863 | | | | |
| Actions propres (détenues direct | R0710 | | | | | |
| Dividendes, distributions et char | R0720 | | | | | |
| Autres éléments de fonds propre | R0730 | 55 695 | | | | |
| Ajustement pour les éléments de | R0740 | 0 | | | | |
| Autres fonds propres non dispon | R0750 | | | | | |
| Réserve de réconciliation | R0760 | 273 167 | | | | |
| Bénéfices attendus | | | | | | |
| Bénéfices attendus inclus dans le | R0770 | 41 815 | | | | |
| Bénéfices attendus inclus dans le | R0780 | | | | | |
| Total bénéfices attendus inclus da | R0790 | 41 815 | | | | |

F.1.1.7.1 Groupe / SII / QRT S.25.01.22 - Formule Standard - SCR de base

| | | Capital de solvabilité requis brut | Simplifications |
|--|--------------|------------------------------------|-----------------|
| | | C0110 | C0120 |
| Risque de marché | R0010 | 335 100 | |
| Risque de défaut de la contrepartie | R0020 | 7 671 | |
| Risque de souscription en vie | R0030 | 274 240 | |
| Risque de souscription en santé | R0040 | 0 | |
| Risque de souscription en non-vie | R0050 | 0 | |
| Diversification | R0060 | -131 373 | |
| Risque lié aux immobilisations incorporelles | R0070 | 0 | |
| Capital de solvabilité requis de base | R0100 | 485 638 | |

F.1.1.7.2 Groupe / SII / QRT S.25.01.22 - Formule Standard - SCR

| | | C0110 |
|--|--------------|----------------|
| Risque opérationnel | R0130 | 23 520 |
| Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques | R0140 | -379 377 |
| Capacité d'absorption des pertes des impôts différés | R0150 | 0 |
| Capital requis pour les activités exercées | R0160 | 0 |
| Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire | R0200 | 129 781 |
| Exigences de capital supplémentaire déjà définies | R0210 | 0 |
| Capital de solvabilité requis | R0220 | 129 781 |
| Autres informations sur le SCR | | |
| Capital requis pour le sous-modu | R0400 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis n | R0410 | 129 781 |
| Total du capital de solvabilité requis n | R0420 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis n | R0430 | 0 |
| Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304 | R0440 | 0 |
| | R0470 | 63 796 |
| Informations sur les autres entités | | |

| | | Co110 |
|---|--------------|----------------|
| Capital requis pour les autres secteurs financiers (capital requis hors assurance) | R0500 | 4 864 |
| Capital requis pour les autres secteurs financiers (capital requis hors assurance) – Établissements de crédit, sociétés d'investissement et établissements financiers, gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs, sociétés de gestion d'OPCVM | R0510 | 4 864 |
| Capital requis pour les autres secteurs financiers (capital requis hors assurance) – Institutions de retraite professionnelle | R0520 | 0 |
| Capital requis pour les autres secteurs financiers (capital requis hors assurance) – capital requis pour les entités non réglementées exerçant des activités financières | R0530 | 0 |
| Capital requis pour les exigences relatives aux participations ne donnant pas le contrôle | R0540 | 0 |
| Capital requis pour entreprises résiduelles | R0550 | 0 |
| SCR global | | 0 |
| SCR pour les entreprises incluses par déduction et agrégation | R0560 | 0,00 |
| Capital de solvabilité requis | R0570 | 134 645 |

F.1.1.8 Groupe / SII / QRT S.25.02.22 / Capital de solvabilité - Formule Standard et modèle interne partiel

Non applicable.

F.1.1.9 Groupe / SII / QRT S.25.03.22 / Capital de solvabilité - modèle interne intégral

Non applicable.

F.1.2. Déclarations quantitatives des Associations Mutuelles Le Conservateur

F.1.2.1a ASSO / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Actifs

| | | C0010 |
|---|--------------|--------------|
| Actifs | | 0 |
| Immobilisations incorporelles | R0030 | 0 |
| Actifs d'impôts différés | R0040 | 2 623 |
| Excédents du régime de retraite | R0050 | 0 |
| Immobilisations corporelles détenues pour usage propre | R0060 | 35 141 |
| Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés) | R0070 | 67 611 |
| Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre) | R0080 | 0 |
| Détentions dans des entreprises liées, y compris participations | R0090 | 6 395 |
| Actions | R0100 | 0 |
| Actions - cotées | R0110 | 0 |
| Actions - non cotées | R0120 | 0 |
| Obligations | R0130 | 60 005 |
| Obligations d'État | R0140 | 7 662 |
| Obligations d'entreprise | R0150 | 52 343 |
| Titres structurés | R0160 | 0 |
| Titres garantis | R0170 | 0 |
| Organismes de placement collectif | R0180 | 451 |
| Produits dérivés | R0190 | 0 |
| Dépôts autres que les équivalents de trésorerie | R0200 | 760 |
| Autres investissements | R0210 | 0 |
| Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés | R0220 | 4 137 496 |
| Prêts et prêts hypothécaires | R0230 | 0 |
| Avances sur police | R0240 | 0 |
| Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers | R0250 | 0 |
| Autres prêts et prêts hypothécaires | R0260 | 0 |
| Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance | R0270 | 0 |
| Non-vie et santé similaire à la non-vie | R0280 | 0 |
| Non-vie hors santé | R0290 | 0 |
| Santé similaire à la non-vie | R0300 | 0 |

| | | C0010 |
|--|--------------|------------------|
| Vie et santé similaire à la vie, hors santé UC et indexés | R0310 | 0 |
| Santé similaire à la vie | R0320 | 0 |
| Vie hors santé, UC et indexés | R0330 | 0 |
| Vie UC et indexés | R0340 | 0 |
| Dépôts auprès des cédantes | R0350 | 0 |
| Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires | R0360 | 1 534 |
| Créances nées d'opérations de réassurance | R0370 | 0 |
| Autres créances (hors assurance) | R0380 | 45 521 |
| Actions propres auto-détenues (directement) | R0390 | 0 |
| Eléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s) | R0400 | 0 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | R0410 | 212 333 |
| Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus | R0420 | 0 |
| Total de l'actif | R0500 | 4 502 258 |

F.1.2.1b ASSO / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Passifs

| | | C0010 |
|---|--------------|--------------|
| Passifs | | 0 |
| Provisions techniques non-vie | R0510 | 0 |
| Provisions techniques non-vie (hors santé) | R0520 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0530 | 0 |
| Meilleure estimation | R0540 | 0 |
| Marge de risque | R0550 | 0 |
| Provisions techniques santé (similaire à la non-vie) | R0560 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0570 | 0 |
| Meilleure estimation | R0580 | 0 |
| Marge de risque | R0590 | 0 |
| Provisions techniques vie (hors UC et indexés) | R0600 | 78 856 |
| Provisions techniques santé (similaire à la vie) | R0610 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0620 | 0 |
| Meilleure estimation | R0630 | 0 |
| Marge de risque | R0640 | 0 |
| Provisions techniques vie (hors santé, UC et indexés) | R0650 | 78 856 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0660 | 78 856 |
| Meilleure estimation | R0670 | 0 |
| Marge de risque | R0680 | 0 |
| Provisions techniques UC et indexés | R0690 | 4 344 428 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0700 | 0 |

| | | C0010 |
|--|--------------|--------------|
| Meilleure estimation | R0710 | 4 338 698 |
| Marge de risque | R0720 | 5 730 |
| Passifs éventuels | R0740 | 0 |
| Provisions autres que les provisions techniques | R0750 | 479 |
| Provisions pour retraite | R0760 | 632 |
| Dépôts des réassureurs | R0770 | 0 |
| Passifs d'impôts différés | R0780 | 0 |
| Produits dérivés | R0790 | 0 |
| Dettes envers des établissements de crédit | R0800 | 0 |
| Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit | R0810 | 0 |
| Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires | R0820 | 23 |
| Dettes nées d'opérations de réassurance | R0830 | 0 |
| Autres dettes (hors assurance) | R0840 | 33 289 |
| Passifs subordonnés | R0850 | 0 |
| Passifs subordonnés non inclus dans les fonds propres de base | R0860 | 0 |
| Passifs subordonnés inclus dans les fonds propres de base | R0870 | 0 |
| Autres dettes non mentionnées dans les postes ci-dessus | R0880 | 0 |
| Total du passif | R0900 | 4 457 707 |
| Excédent d'actif sur passif | R1000 | 44 552 |

F.1.2.2 ASSO / SII / QRT S.05.01.02.02 - Primes, sinistres et dépenses par ligne d'activité

| | | Ligne d'activité pour: engagements d'assurance vie | | | | | | Engagements de réassurance vie | | Total |
|---|--------------|--|--|--|-----------------------|--|---|--------------------------------|-----------------|---------------|
| | | Assurance maladie | Assurance avec participation aux bénéfices | Assurance indexée et en unités de compte | Autres assurances vie | Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance santé | Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance autres que les engagements d'assurance santé | Réassurance maladie | Réassurance vie | |
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | |
| Primes émises | | | | | | | | | | |
| Brut | R1410 | | | 416 963 | | | | | | 416 963 |
| Part des réassureurs | R1420 | | | | | | | | | |
| Net | R1500 | | | 416 963 | | | | | | 416 963 |
| Primes acquises | | | | | | | | | | |
| Brut | R1510 | | | 416 963 | | | | | | 416 963 |
| Part des réassureurs | R1520 | | | | | | | | | |
| Net | R1600 | | | 416 963 | | | | | | 416 963 |
| Charge des sinistres | | | | | | | | | | |
| Brut | R1610 | | | 335 921 | | | | | | 335 921 |
| Part des réassureurs | R1620 | | | | | | | | | |
| Net | R1700 | | | 335 921 | | | | | | 335 921 |
| Variation des autres provisions techniques | | | | | | | | | | |
| Brut | R1710 | | | | | | | | | |
| Part des réassureurs | R1720 | | | | | | | | | |
| Net | R1800 | | | | | | | | | |
| Dépenses engagées | | | | | | | | | | |
| Dépenses engagées | R1900 | | | 57 293 | | | | | | 57 293 |
| Autres dépenses | | | | | | | | | | |
| Autres dépenses | R2500 | | | | | | | | | |
| Total des dépenses | R2600 | | | | | | | | | 57 293 |

F.1.2.3 ASSO / SII / QRT S.05.02.01 - Primes, sinistres et dépenses par pays

Sans objet car la totalité des primes est comptabilisée sur la France.

F.1.2.4 ASSO / SII / QRT S.12.01.02 - Provisions techniques vie et santé similaire à la vie

| | | Assurance indexée et en unités de compte | | | | Autres assurances vie | | Revenus déduits des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance autres que les engagements | Réassurance acceptée | Total (vie hors santé, y compris UC) | |
|--|-------|--|------------------------------------|-----------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|----------------------|--------------------------------------|-----------|
| | | Assurance avec participation aux bénéfices | Contrats sans options ni garanties | | Contrats avec options ou garanties | Contrats sans options ni garanties | Contrats avec options ou garanties | | | | |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | | | | C0080 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0010 | 78 856 | | | | | | | | | 78 856 |
| Total des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie, après l'ajustement pour pertes probables pour défaut de la contrepartie, correspondant aux provisions techniques calculées comme un tout | R0020 | | | | | | | | | | |
| Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque | | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation | | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation brute | R0030 | | | 4 338 698 | | | | | | | 4 338 698 |
| Total des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie, après ajustement pour pertes probables pour défaut de la contrepartie | R0080 | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation nette des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie – total | R0090 | | | 4 338 698 | | | | | | | 4 338 698 |
| Marge de risque | R0100 | | 5 730 | | | | | | | | 5 730 |
| Montant de la déduction transitoire sur les provisions techniques | | | | | | | | | | | |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0110 | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation | R0120 | | | | | | | | | | |
| Marge de risque | R0130 | | | | | | | | | | |
| Provisions techniques – Total | R0200 | 78 856 | 4 344 428 | | | | | | | | 4 423 284 |

F.1.2.5 ASSO / SII / QRT S.17.01.02 - Provisions techniques non vie

Non applicable

F.1.2.6 ASSO / SII / QRT S.19.01.21 - Triangles de développement en assurance non vie

Non applicable

F.1.2.7 ASSO / SII / QRT S.22.01.21 - Mesures transitoires

Non reporté

| | | Total | Niveau 1 – non restreint | Niveau 1 – restreint | Niveau 2 | Niveau 3 |
|---|-------|--------|--------------------------|----------------------|----------|----------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Fonds propres de base avant déduction pour participations dans d'autres secteurs financiers, comme prévu à l'article 68 du règlement délégué (UE) 2015/35 | | | | | | |
| Capital en actions ordinaires (brut des actions propres) | R0010 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires | R0030 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalent pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0040 | 2 678 | 2 678 | | | |
| Comptes mutualistes subordonnés | R0050 | | | | | |
| Fonds excédentaires | R0070 | | | | | |
| Actions de préférence | R0090 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence | R0110 | | | | | |
| Réserve de réconciliation | R0130 | 39 251 | 39 251 | | | |
| Passifs subordonnés | R0140 | | | | | |
| Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets | R0160 | 2 623 | | | | 2 623 |
| Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra | R0180 | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | R0220 | 243 | | | | |
| Déductions | | | | | | |

| | | Total | Niveau 1 – non restreint | Niveau 1 – restreint | Niveau 2 | Niveau 3 |
|--|--------------|--------|--------------------------|----------------------|----------|----------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Déductions pour participations dans des établissements de crédit et des établissements financiers | R0230 | | | | | |
| Total fonds propres de base après déductions | R0290 | | | | | |
| Fonds propres auxiliaires | | | | | | |
| Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande | R0300 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalents, non libérés, non appelés et appelables sur demande, pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0310 | | | | | |
| Actions de préférence non libérées et non appelées, appelables sur demande | R0320 | | | | | |
| Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande | R0330 | | | | | |
| Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0340 | | | | | |
| Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0350 | | | | | |
| Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE | R0360 | | | | | |
| Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE | R0370 | | | | | |
| Autres fonds propres auxiliaires | R0390 | | | | | |
| Total fonds propres auxiliaires | R0400 | | | | | |
| Fonds propres éligibles et disponibles | | | | | | |
| Total des fonds propres disponibles | R0500 | 44 309 | 41 686 | | | 2 623 |
| Total des fonds propres disponibles | R0510 | 41 686 | 41 686 | | | |
| Total des fonds propres éligibles pour couvrir le capital de solvabilité requis | R0540 | 43 760 | 41 686 | | | 2 074 |
| Total des fonds propres éligibles | R0550 | 41 686 | 41 686 | | | |
| Capital de solvabilité requis | R0580 | 13 827 | | | | |
| Minimum de capital requis | R0600 | 6 222 | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis | R0620 | 316% | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital requis | R0640 | 670% | | | | |

F.1.2.8.2 ASSO / SII / QRT S.23.01.01 - Réserve de réconciliation

| | | C0060 | |
|--|--------------|---------------|--|
| Réserve de réconciliation | | | |
| Excédent d'actif sur passif | R0700 | 44 552 | |
| Actions propres (détenues directement et indirectement) | R0710 | | |
| Dividendes, distributions et charges prévisibles | R0720 | | |
| Autres éléments de fonds propres de base | R0730 | 5 301 | |
| Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux portefeuilles sous ajustement égalisateur et aux fonds cantonnés | R0740 | | |
| Réserve de réconciliation | R0760 | 39 251 | |
| Bénéfices attendus | | | |
| Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités vie | R0770 | 37 544 | |
| Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités non-vie | R0780 | | |
| Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) | R0790 | 37 544 | |

F.1.2.9.1 ASSO / SII / QRT S.25.01.21.01 - Formule Standard - SCR de base

| | | Capital de solvabilité requis brut | Simplifications |
|--|--------------|------------------------------------|-----------------|
| | | C0110 | C0120 |
| Risque de marché | R0010 | 3 067 | |
| Risque de défaut de la contrepartie | R0020 | 5 296 | |
| Risque de souscription en vie | R0030 | 2 006 | |
| Risque de souscription en santé | R0040 | 0 | |
| Risque de souscription en non-vie | R0050 | 0 | |
| Diversification | R0060 | -2 754 | |
| Risque lié aux immobilisations incorporelles | R0070 | 0 | |
| Capital de solvabilité requis de base | R0100 | 7 615 | |

F.1.2.9.2 ASSO / SII / QRT S.25.01.21.02 - Formule Standard - SCR

| | | C0100 |
|---|--------------|---------------|
| Risque opérationnel | R0130 | 6 212 |
| Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques | R0140 | 0 |
| Capacité d'absorption des pertes des impôts différés | R0150 | 0 |
| Capital requis pour les activités exercées conformément à l'article 4 de la directive 2003/41/CE | R0160 | 0 |
| Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire | R0200 | 13 827 |
| Exigences de capital supplémentaire déjà définies | R0210 | 0 |
| Capital de solvabilité requis | R0220 | 13 827 |
| Autres informations sur le SCR | | |
| Capital requis pour le sous-module risque sur actions fondé sur la durée | R0400 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour la part restante | R0410 | 13 827 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les fonds cantonnés | R0420 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les portefeuilles sous ajustement égalisateur | R0430 | 0 |
| Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304 | R0440 | 0 |

F.1.2.10 ASSO / SII / QRT S.25.02.21 Capital de solvabilité requis – Formule Standard et modèle interne partiel

Non applicable

F.1.2.11 ASSO / SII / QRT S.25.03.21 - Capital de solvabilité requis en modèle interne intégral

Non applicable

F.1.2.12.1a ASSO / SII / QRT S.28.01.01 - MCR Linéaire

| | | C0040 |
|---------------|-------|--------|
| Résultat MCRL | R0200 | 33 289 |

F.1.2.12.1b ASSO / SII / QRT S.28.01.01 - MCR de base

| | | Meilleure estimation et PT calculées comme un tout, nettes (de la réassurance / des véhicules de titrisation) | Montant total du capital sous risque net (de la réassurance/ des véhicules de titrisation) |
|---|--------------|---|--|
| | | C0050 | C0060 |
| Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations garanties | R0210 | 78 856 | |
| Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations discrétionnaires futures | R0220 | 0 | |
| Engagements d'assurance avec prestations indexées et en unités de compte | R0230 | 4 338 698 | |
| Autres engagements de (ré)assurance vie et de (ré)assurance santé | R0240 | 0 | |
| Montant total du capital sous risque pour tous les engagements de (ré)assurance vie | R0250 | | 0 |

F.1.2.12.2 ASSO / SII / QRT S.28.01.01 - MCR global

| | | C0070 |
|----------------------------------|--------------|--------------|
| MCR linéaire | R0300 | 33 289 |
| Capital de solvabilité requis | R0310 | 13 827 |
| Plafond du MCR | R0320 | 6 222 |
| Plancher du MCR | R0330 | 3 457 |
| MCR combiné | R0340 | 6 222 |
| Seuil plancher absolu du MCR | R0350 | 3 700 |
| Minimum de capital requis | R0400 | 6 222 |

F.1.3 Déclarations quantitatives des Assurances Mutuelles Le Conservateur

F.1.3.1a ASSU / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Actifs

| | | C0010 |
|---|--------------|-----------|
| Actifs | | |
| Immobilisations incorporelles | R0030 | 0 |
| Actifs d'impôts différés | R0040 | 0 |
| Excédents du régime de retraite | R0050 | 0 |
| Immobilisations corporelles détenues pour usage propre | R0060 | 11 434 |
| Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés) | R0070 | 2 607 035 |
| Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre) | R0080 | 0 |
| Détentions dans des entreprises liées, y compris participations | R0090 | 60 527 |
| Actions | R0100 | 416 |
| Actions - cotées | R0110 | 0 |
| Actions - non cotées | R0120 | 416 |
| Obligations | R0130 | 2 003 712 |
| Obligations d'État | R0140 | 592 900 |
| Obligations d'entreprise | R0150 | 1 346 547 |
| Titres structurés | R0160 | 64 265 |
| Titres garantis | R0170 | 0 |
| Organismes de placement collectif | R0180 | 501 797 |
| Produits dérivés | R0190 | 0 |
| Dépôts autres que les équivalents de trésorerie | R0200 | 40 584 |
| Autres investissements | R0210 | 0 |
| Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés | R0220 | 2 886 892 |
| Prêts et prêts hypothécaires | R0230 | 21 713 |
| Avances sur police | R0240 | 21 707 |
| Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers | R0250 | 6 |
| Autres prêts et prêts hypothécaires | R0260 | 0 |
| Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance | R0270 | -4 150 |
| Non-vie et santé similaire à la non-vie | R0280 | 0 |
| Non-vie hors santé | R0290 | 0 |
| Santé similaire à la non-vie | R0300 | 0 |
| Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés | R0310 | -4 150 |
| Santé similaire à la vie | R0320 | 0 |

| | | C0010 |
|--|--------------|------------------|
| Vie hors santé, UC et indexés | R0330 | -4 150 |
| Vie UC et indexés | R0340 | 0 |
| Dépôts auprès des cédantes | R0350 | 0 |
| Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires | R0360 | 1 526 |
| Créances nées d'opérations de réassurance | R0370 | 591 |
| Autres créances (hors assurance) | R0380 | 15 822 |
| Actions propres auto-détenues (directement) | R0390 | 0 |
| Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore pavé(s) | R0400 | 0 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | R0410 | 24 753 |
| Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus | R0420 | 0 |
| Total de l'actif | R0500 | 5 565 617 |

F.1.3.1b ASSU / SII / QRT S.02.01.02 - Bilan Passifs

| Passifs | | C0010 | |
|--|--------------|------------|--------|
| | | | |
| Provisions techniques non-vie | R0510 | | 0 |
| Provisions techniques non-vie | R0520 | | 0 |
| Provisions techniques ca | R0530 | | 0 |
| Meilleure estimation | R0540 | | 0 |
| Marge de risque | R0550 | | 0 |
| Provisions techniques santé (si | R0560 | | 0 |
| Provisions techniques ca | R0570 | | 0 |
| Meilleure estimation | R0580 | | 0 |
| Marge de risque | R0590 | | 0 |
| Provisions techniques vie (hors UC et | R0600 | 2 537 292 | |
| Provisions techniques santé (si | R0610 | | 0 |
| Provisions techniques ca | R0620 | | 0 |
| Meilleure estimation | R0630 | | 0 |
| Marge de risque | R0640 | | 0 |
| Provisions techniques vie | R0650 | 2 537 292 | |
| (hors santé, UC et indexés) | | | |
| Provisions techniques ca | R0660 | 25 622 539 | |
| Meilleure estimation | R0670 | 2 493 720 | |
| Marge de risque | R0680 | 10 409 | |
| Provisions techniques UC et indexés | R0690 | 2 696 339 | |
| Provisions techniques calculées | R0700 | 7 539 541 | |
| Meilleure estimation | R0710 | 2 649 928 | |
| Marge de risque | R0720 | 46 412 | |
| Passifs éventuels | R0740 | | 0 |
| Provisions autres que les provisions t | R0750 | | 584 |
| Provisions pour retraite | R0760 | | 1 261 |
| Dépôts des réassureurs | R0770 | | 513 |
| Passifs d'impôts différés | R0780 | | 0 |
| Produits dérivés | R0790 | | 0 |
| Dettes envers des établissements de c | R0800 | | 0 |
| Dettes financières autres que celles | R0810 | | 0 |
| envers les établissements de crédit | | | |
| Dettes nées d'opérations d'assurance | R0820 | | 6 552 |
| Dettes nées d'opérations de réassur | R0830 | | 301 |
| Autres dettes (hors assurance) | R0840 | | 33 241 |
| Passifs subordonnés | R0850 | | 0 |
| Passifs subordonnés non inclus | R0860 | | 0 |
| Passifs subordonnés inclus dan | R0870 | | 0 |
| Autres dettes non mentionnées dans | R0880 | | 0 |
| Total du passif | R0900 | 5 276 084 | |
| Excédent d'actif sur passif | R1000 | 289 533 | |

F.1.3.2 ASSU / SII / QRT S.05.01.02.02 - Primes, sinistres et dépenses par ligne d'activité

| | | Ligne d'activité pour: engagements d'assurance vie | | | | | Engagements de réassurance vie | | Total | |
|---|-------|--|--|--|-----------------------|--|---|---------------------|-------|---------------------|
| | | Assurance maladie | Assurance avec participation aux bénéfices | Assurance indexée et en unités de compte | Autres assurances vie | Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance santé | Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance autres que les engagements d'assurance santé | Réassurance maladie | | Réassurance maladie |
| | | C0210 | C0220 | C0230 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0300 |
| Primes émises | | | | | | | | | | |
| Brut | R1410 | | 192 128 | 331 917 | 4 253 | | | | | 528 297 |
| Part des réassureurs | R1420 | | 34 836 | | 411 | | | | | 35 246 |
| Net | R1500 | 0 | 157 292 | 331 917 | 3 842 | 0 | 0 | 0 | 0 | 493 051 |
| Primes acquises | | | | | | | | | | |
| Brut | R1510 | 0 | 192 128 | 331 917 | 4 253 | 0 | 0 | 0 | 0 | 528 297 |
| Part des réassureurs | R1520 | 0 | 34 836 | 0 | 411 | 0 | 0 | 0 | 0 | 35 246 |
| Net | R1600 | 0 | 157 292 | 331 917 | 3 842 | 0 | 0 | 0 | 0 | 493 051 |
| Charge des sinistres | | | | | | | | | | |
| Brut | R1610 | | 225 131 | 159 360 | 11 201 | | | | | 395 693 |
| Part des réassureurs | R1620 | | 44 432 | | 2 056 | | | | | 46 489 |
| Net | R1700 | 0 | 180 699 | 159 360 | 9 145 | 0 | 0 | 0 | 0 | 349 204 |
| Variation des autres provisions techniques | | | | | | | | | | |
| Brut | R1710 | | | | | | | | | 0 |
| Part des réassureurs | R1720 | | | | | | | | | |
| Net | R1800 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dépenses engagées | R1900 | | 37 063 | 23 802 | 865 | | | | | 61 729 |
| Autres dépenses | R2500 | | | | | | | | | 20 703 |
| Total des dépenses | R2600 | | | | | | | | | 82 432 |

F.1.3.3 ASSU / SII / QRT S.05.02.01 - Primes, sinistres et dépenses par pays

Sans objet car la totalité des primes est comptabilisée sur la France.

F.1.3.4 ASSU / SII / QRT S.12.01.02 - Provisions techniques vie et santé similaire à la vie

| | | Assurance indexée et en unités de compte | | | | Autres assurances vie | | | Revenus de contrats d'assurance non-vie et liés aux engagements d'assurance autres que les engagements d'assurances-santé | Réassurance acceptée | Total (vie hors santé, y compris UC) |
|---|-------|--|------------------------------------|-----------|------------------------------------|------------------------------------|-------|------------------------------------|---|----------------------|--------------------------------------|
| | | Assurance avec participation aux bénéfices | Contrats sans options ni garanties | | Contrats avec options ou garanties | Contrats sans options ni garanties | | Contrats avec options ou garanties | | | |
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | | | |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0010 | 23 743 | 7 540 | | | 1 880 | | | 0 | 0 | 33 162 |
| Total des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite, après l'ajustement pour pertes probables pour défaut de la contrepartie, correspondant aux provisions techniques calculées comme un tout | R0020 | 0 | 0 | | | 0 | | | 0 | 0 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque | | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation | | | | | | | | | | | |
| Meilleure estimation brute | R0030 | 2 492 161 | | 2 649 218 | 710 | | 1 559 | 0 | 0 | 0 | 5 143 648 |
| Total des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite, après ajustement pour pertes probables pour défaut de la contrepartie | R0080 | -4 159 | | 0 | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | -4 159 |
| Meilleure estimation nette des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite – total | R0090 | 2 496 311 | | 2 649 218 | 710 | | 1 559 | 0 | 0 | 0 | 5 147 798 |
| Marge de risque | R0100 | 10 493 | 46 412 | | | 6 | | | 0 | 0 | 56 821 |
| Montant de la déduction transitoire sur les provisions techniques | | | | | | | | | | | |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0110 | | | | | 0 | | | | | |
| Meilleure estimation | R0120 | | | 0 | 0 | | | | | | |
| Marge de risque | R0130 | | | | | | | | | | |
| Provisions techniques – Total | R0200 | 2 526 307 | 2 703 879 | | | 3 445 | | | 0 | 0 | 5 233 631 |

F.1.3.5 ASSU / SII / QRT S.17.01.02 - Provisions techniques non vie

Non applicable

F.1.3.6 ASSU / SII / QRT S.19.01.21 - Triangles de développement en assurance non vie

Non applicable

F.1.3.7 ASSU / SII / QRT S.22.01.21 - Mesures transitoires

| | | Montant avec mesures relatives aux garanties de long terme et mesures transitoires | Impact des mesures transitoires sur les provisions techniques | Impact des mesures transitoires sur les taux d'intérêt | Impact d'une correction pour volatilité fixée à zéro | Impact d'un ajustement égalisateur fixé à zéro |
|---|--------------|--|---|---|--|---|
| | | C0010 | C0030 | C0050 | C0070 | C0090 |
| Provisions techniques | R0010 | 5 233 631 | | | 36 489 | |
| Fonds propres de base | R0020 | 288 731 | | | -5 674 | |
| Fonds propres éligibles pour couvrir le | R0050 | 288 731 | | | -5 674 | |
| Capital de solvabilité requis | R0090 | 121 349 | | | -5 399 | |
| Fonds propres éligibles pour couvrir le | R0100 | 288 731 | | | -5 674 | |
| Minimum de capital requis | R0110 | 54 607 | | | -2 430 | |

| | | Total | Niveau 1 – non restreint | Niveau 1 – restreint | Niveau 2 | Niveau 3 |
|---|--------------|---------|--------------------------|----------------------|----------|----------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Fonds propres de base avant déduction pour participations dans d'autres secteurs financiers, comme prévu à l'article 68 du règlement délégué (UE) 2015/35 | | | | | | |
| Capital en actions ordinaires (brut des actions propres) | R0010 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires | R0030 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalent pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0040 | 2 503 | 2 503 | | | |
| Comptes mutualistes subordonnés | R0050 | | | | | |
| Fonds excédentaires | R0070 | 50 514 | 50 514 | | | |
| Actions de préférence | R0090 | | | | | |
| Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence | R0110 | | | | | |
| Réserve de réconciliation | R0130 | 236 516 | 236 516 | | | |
| Passifs subordonnés | R0140 | | | | | |
| Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets | R0160 | | | | | |
| Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra | R0180 | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | | | | | | |
| Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus dans la réserve de réconciliation et qui ne respectent pas les critères de fonds propres de Solvabilité II | R0220 | 802 | | | | |

| | | Total | Niveau 1 – non restreint | Niveau 1 – restreint | Niveau 2 | Niveau 3 |
|--|-------|---------|--------------------------|----------------------|----------|----------|
| | | C0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 |
| Déductions | | | | | | |
| Déductions pour participations dans des établissements de crédit et des établissements financiers | R0230 | | | | | |
| Total fonds propres de base après déductions | R0290 | 288 731 | 288 731 | | | |
| Fonds propres auxiliaires | | | | | | |
| Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande | R0300 | | | | | |
| Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalents, non libérés, non appelés et appelables sur demande, pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel | R0310 | | | | | |
| Actions de préférence non libérées et non appelées, callable sur demande | R0320 | | | | | |
| Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande | R0330 | | | | | |
| Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0340 | | | | | |
| Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE | R0350 | | | | | |
| Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE | R0360 | | | | | |
| Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE | R0370 | | | | | |
| Autres fonds propres auxiliaires | R0390 | | | | | |
| Total fonds propres auxiliaires | R0400 | | | | | |
| Fonds propres éligibles et disponibles | | | | | | |
| Total des fonds propres disponibles | R0500 | 288 731 | 288 731 | | | |
| Total des fonds propres disponibles | R0510 | 288 731 | 288 731 | | | |
| Total des fonds propres éligibles pour couvrir le capital de solvabilité requis | R0540 | 288 731 | 288 731 | | | |
| Total des fonds propres éligibles | R0550 | 288 731 | 288 731 | | | |
| Capital de solvabilité requis | R0580 | 121 349 | | | | |
| Minimum de capital requis | R0600 | 54 607 | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis | R0620 | 238% | | | | |
| Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital requis | R0640 | 529% | | | | |

F.1.3.8.2 ASSU / SII / QRT S.23.01.01 - Réserve de réconciliation

| | | C0060 | |
|--|--------------|----------------|--|
| Réserve de réconciliation | | | |
| Excédent d'actif sur passif | R0700 | 289 533 | |
| Actions propres (détenues directement et indirectement) | R0710 | | |
| Dividendes, distributions et charges prévisibles | R0720 | | |
| Autres éléments de fonds propres de base | R0730 | 53 017 | |
| Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux portefeuilles sous ajustement égalisateur et aux fonds cantonnés | R0740 | | |
| Réserve de réconciliation | R0760 | 236 516 | |
| Bénéfices attendus | | | |
| Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités vie | R0770 | 4 679 | |
| Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités non-vie | R0780 | | |
| Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) | R0790 | 4 679 | |

F.1.3.9.1 ASSU / SII / QRT S.25.01.21.01 - Formule Standard - SCR de base

| | | Capital de solvabilité requis brut | Simplifications |
|--|--------------|------------------------------------|-----------------|
| | | C0110 | C0120 |
| Risque de marché | R0010 | 335 807 | |
| Risque de défaut de la contrepartie | R0020 | 3 871 | |
| Risque de souscription en vie | R0030 | 272 767 | |
| Risque de souscription en santé | R0040 | 0 | |
| Risque de souscription en non-vie | R0050 | 0 | |
| Diversification | R0060 | -128 544 | |
| Risque lié aux immobilisations incorporelles | R0070 | 0 | |
| Capital de solvabilité requis de base | R0100 | 483 900 | |

F.1.3.9.2 ASSU / SII / QRT S.25.01.21.02 - Formule Standard - SCR

| | | C0100 |
|---|--------------|-------------------|
| Risque opérationnel | R0130 | 17 308 |
| Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques | R0140 | -379 859 |
| Capacité d'absorption des pertes des impôts différés | R0150 | 0 |
| Capital requis pour les activités exercées conformément à l'article 4 de la directive 2003/41/CE | R0160 | 0 |
| Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire | R0200 | 121 349 |
| Exigences de capital supplémentaire déjà définies | R0210 | 0 |
| Capital de solvabilité requis | R0220 | 121 349 |
| Autres informations sur le SCR | | XXXXXX |
| Capital requis pour le sous-module risque sur actions fondé sur la durée | R0400 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour la part restante | R0410 | 102 019 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les fonds cantonnés | R0420 | 22 680 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les portefeuilles sous ajustement égalisateur | R0430 | 0 |
| Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304 | R0440 | 0 |

F.1.3.10 ASSU / SII / QRT S.25.02.21 Capital de solvabilité requis – Formule Standard et modèle interne partiel

Non applicable

F.1.3.11 ASSU / SII / QRT S.25.03.21 - Capital de solvabilité requis en modèle interne intégral

Non applicable

F.1.3.12.1a ASSU / SII / QRT S.28.01.01 - MCR Linéaire

| | | C0040 |
|---------------|--------------|--------------|
| Résultat MCRL | R0200 | 74 484 |

F.1.3.12.1b ASSU / SII / QRT S.28.01.01 - MCR de base

| | | Meilleure estimation et PT calculées comme un tout, nettes (de la réassurance / des véhicules de titrisation) | Montant total du capital sous risque net (de la réassurance/ des véhicules de titrisation) |
|---|--------------|---|--|
| | | C0050 | C0060 |
| Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations garanties | R0210 | 2 100 150 | |
| Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations discrétionnaires futures | R0220 | 470 419 | |
| Engagements d'assurance avec prestations indexées et en unités de compte | R0230 | 2 657 467 | |
| Autres engagements de (ré)assurance vie et de (ré)assurance santé | R0240 | 3 439 | |
| Montant total du capital sous risque pour tous les engagements de (ré)assurance vie | R0250 | | 3 665 795 |

F.1.3.12.2 ASSU / SII / QRT S.28.01.01 - MCR global

| | | C0070 |
|----------------------------------|--------------|---------------|
| MCR linéaire | R0300 | 74 484 |
| Capital de solvabilité requis | R0310 | 121 349 |
| Plafond du MCR | R0320 | 54 607 |
| Plancher du MCR | R0330 | 30 337 |
| MCR combiné | R0340 | 54 607 |
| Seuil plancher absolu du MCR | R0350 | 3 700 |
| Minimum de capital requis | R0400 | 54 607 |