

## GB Life Luxembourg

### S.02.01.02

#### Bilan

		Valeur Solvabilité II
		C0010
<b>Actifs</b>		
Immobilisations incorporelles	R0030	0
Actifs d'impôts différés	R0040	0
Excédent du régime de retraite	R0050	0
Immobilisations corporelles détenues pour usage propre	R0060	156
Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés)	R0070	58 522
Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre)	R0080	0
Détenions dans des entreprises liées, y compris participations	R0090	0
Actions	R0100	0
Actions - cotées	R0110	0
Actions - non cotées	R0120	0
Obligations	R0130	46 379
Obligations d'État	R0140	43 466
Obligations d'entreprise	R0150	2 914
Titres structurés	R0160	0
Titres garantis	R0170	0
Organismes de placement collectif	R0180	12 142
Produits dérivés	R0190	0
Dépôts autres que les équivalents de trésorerie	R0200	0
Autres investissements	R0210	0
Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés	R0220	2 116 388
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	-822
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	0
Santé similaire à la vie	R0320	0
Vie hors santé, UC et indexés	R0330	0
Vie UC et indexés	R0340	-822
Dépôts auprès des cédantes	R0350	0
Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires	R0360	0
Créances nées d'opérations de réassurance	R0370	0
Autres créances (hors assurance)	R0380	5 901
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	9 118
Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus	R0420	319
<b>Total de l'actif</b>	<b>R0500</b>	<b>2 189 582</b>

## GB Life Luxembourg

### S.02.01.02

#### Bilan

		Valeur Solvabilité II C0010
<b>Passifs</b>		
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	45 486
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	45 486
Provisions techniques calculées comme un tout	R0660	0
Meilleure estimation	R0670	42 646
Marge de risque	R0680	2 840
Provisions techniques UC et indexés	R0690	2 092 601
Provisions techniques calculées comme un tout	R0700	0
Meilleure estimation	R0710	2 085 935
Marge de risque	R0720	6 666
Passifs éventuels	R0740	0
Provisions autres que les provisions techniques	R0750	2 308
Provisions pour retraite	R0760	0
Dépôts des réassureurs	R0770	0
Passifs d'impôts différés	R0780	4 018
Produits dérivés	R0790	0
Dettes envers des établissements de crédit	R0800	1 465
Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit	R0810	0
Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires	R0820	11 440
Dettes nées d'opérations de réassurance	R0830	153
Autres dettes (hors assurance)	R0840	0
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	2 284
<b>Total du passif</b>	<b>R0900</b>	<b>2 159 755</b>
<b>Excédent d'actif sur passif</b>	<b>R1000</b>	<b>29 827</b>



## GB Life Luxembourg

### S.05.02.01 - 02

Primes, sinistres et dépenses par pays

		Pays d'origine	5 principaux pays (par montant de primes brutes émises) - engagements en vie	5 principaux pays (par montant de primes brutes émises) - engagements en vie	Total 5 principaux pays et pays d'origine
		C0150	C0160	C0170	C0210
R1400			BE	IT	
		C0220	C0230	C0240	C0280
<b>Primes émises</b>					
Brut	R1410	17 014	100 710	5 053	122 777
Part des réassureurs	R1420	22	1 451	145	1 617
Net	R1500	16 992	99 259	4 908	121 159
<b>Primes acquises</b>					
Brut	R1510	17 014	100 710	5 053	122 777
Part des réassureurs	R1520	22	1 451	145	1 617
Net	R1600	16 992	99 259	4 908	121 159
<b>Charge des sinistres</b>					
Brut	R1610	72 303	168 871	55 398	296 572
Part des réassureurs	R1620	0	-5	0	-5
Net	R1700	72 303	168 876	55 398	296 577
<b>Variation des autres provisions techniques</b>					
Brut	R1710	28 441	-83 981	24 491	-31 048
Part des réassureurs	R1720	0	0	0	0
Net	R1800	28 441	-83 981	24 491	-31 048
Dépenses engagées	R1900	1 612	12 072	1 355	15 038
Autres dépenses	R2500				
Total des dépenses	R2600				

## GB Life Luxembourg

### S.12.01.02 - 01

Provisions techniques vie et santé SLT

		Assurance indexée et en unités de compte				Autres assurances vie			Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liés aux engagements d'assurance autres que les engagements d'assurance santé	Réassurance acceptée	Total (vie hors santé, y compris UC)	Total (santé similaire à la vie)
		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	C0090	C0100	C0150	C0210
<b>Provisions techniques calculées comme un tout</b>	<b>R0010</b>	0	0			0			0	0	0	0
<b>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</b>	<b>R0020</b>	0	0			0			0	0	0	0
<b>Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque</b>												
<b>Meilleure estimation</b>												
<b>Meilleure estimation brute</b>	<b>R0030</b>	39 217		2 027 757	58 178		3 429	0	0	0	2 128 581	0
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	0		0	-822		0	0	0	0	-822	0
Meilleure estimation nette des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite	R0090	39 217		2 027 757	59 000		3 429	0	0	0	2 129 403	0
<b>Marge de risque</b>	<b>R0100</b>	2 832	6 666			8			0	0	9 506	0
<b>Montant de la déduction transitoire sur les provisions techniques</b>												
Provisions techniques calculées comme un tout	R0110	0	0			0			0	0	0	0
Meilleure estimation	R0120	0		0	0		0	0	0	0	0	0
Marge de risque	R0130	0	0			0			0	0	0	0
<b>Provisions techniques - Total</b>	<b>R0200</b>	42 050	2 092 601			3 436			0	0	2 138 087	0

## GB Life Luxembourg

### S.22.01.21

Impact des mesures relatives aux garanties de long terme et des 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	2 138 087	0	0	447	0
Fonds propres de base	R0020	29 827	0	0	-336	0
Fonds propres éligibles pour couvrir le SCR	R0050	29 827	0	0	-336	0
Capital de solvabilité requis	R0090	17 485	0	0	114	0
Fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0100	29 827	0	0	-336	0
Minimum de capital requis	R0110	7 868	0	0	51	0

## GB Life Luxembourg

### S.23.01.01 - 01

#### Fonds propres

		Total	Niveau 1 - non restreint	Niveau 1 - restreint	Niveau 2	Niveau 3
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050
<b>Fonds propres de base avant déduction pour participations dans d'autres secteurs financiers, comme prévu à l'article 68 du règlement délégué 2015/35</b>						
Capital en actions ordinaires (brut des actions propres)	R0010	10 000	10 000		0	
Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires	R0030	1	1		0	
Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalent pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel	R0040	0	0		0	
Comptes mutualistes subordonnés	R0050	0		0	0	0
Fonds excédentaires	R0070	0	0			
Actions de préférence	R0090	0		0	0	0
Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence	R0110	0		0	0	0
Réserve de réconciliation	R0130	19 825	19 825			
Passifs subordonnés	R0140	0		0	0	0
Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets	R0160	0				0
Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra	R0180	0	0	0	0	0
<b>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</b>						
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	0				
<b>Déductions</b>						
Déductions pour participations dans des établissements de crédit et des établissements financiers	R0230	0	0	0	0	0
<b>Total fonds propres de base après déductions</b>	<b>R0290</b>	<b>29 827</b>	<b>29 827</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Fonds propres auxiliaires</b>						
Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande	R0300	0			0	
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	0			0	
Actions de préférence non libérées et non appelées, callable sur demande	R0320	0			0	0
Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande	R0330	0			0	0
Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	R0340	0			0	
Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	R0350	0			0	0
Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE	R0360	0			0	
Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE	R0370	0			0	0
Autres fonds propres auxiliaires	R0390	0			0	0
<b>Total fonds propres auxiliaires</b>	<b>R0400</b>	<b>0</b>			<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Fonds propres éligibles et disponibles</b>						
Total des fonds propres disponibles pour couvrir le capital de solvabilité requis	R0500	29 827	29 827	0	0	0
Total des fonds propres disponibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0510	29 827	29 827	0	0	
Total des fonds propres éligibles pour couvrir le capital de solvabilité requis	R0540	29 827	29 827	0	0	0
Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0550	29 827	29 827	0	0	
<b>Capital de solvabilité requis</b>	<b>R0580</b>	<b>17 485</b>				
<b>Minimum de capital requis</b>	<b>R0600</b>	<b>7 868</b>				
<b>Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis</b>	<b>R0620</b>	<b>1,71</b>				
<b>Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital requis</b>	<b>R0640</b>	<b>3,79</b>				

## GB Life Luxembourg

S.23.01.01 - 02

Fonds propres

		C0060
<b>Réserve de réconciliation</b>		
Excédent d'actif sur passif	R0700	29 827
Actions propres (détenues directement et indirectement)	R0710	0
Dividendes, distributions et charges prévisibles	R0720	0
Autres éléments de fonds propres de base	R0730	10 001
Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux portefeuilles sous ajustement égalisateur et aux fonds cantonnés	R0740	0
<b>Réserve de réconciliation</b>	<b>R0760</b>	<b>19 825</b>
<b>Bénéfices attendus</b>		
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) - activités vie	R0770	0
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) - activités non-vie	R0780	0
<b>Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP)</b>	<b>R0790</b>	<b>0</b>



## GB Life Luxembourg

### S.25.01.21

Capital de solvabilité requis - pour les entreprises qui utilisent la formule standard

		Capital de solvabilité requis brut	Simplifications	PPE
		C0110	C0120	C0090
Risque de marché	R0010	12 849		
Risque de défaut de la contrepartie	R0020	505		
Risque de souscription en vie	R0030	11 988		
Risque de souscription en santé	R0040	0		
Risque de souscription en non-vie	R0050	0		
Diversification	R0060	-5 534		
Risque lié aux immobilisations incorporelles	R0070	0		
<b>Capital de solvabilité requis de base</b>	<b>R0100</b>	<b>19 808</b>		

		C0100
Risque opérationnel	R0130	1 695
Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques	R0140	0
Capacité d'absorption des pertes des impôts différés	R0150	-4 018
Capital requis pour les activités exercées conformément à l'article 4 de la directive 2003/41/CE	R0160	0
<b>Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire</b>	<b>R0200</b>	<b>17 485</b>
Exigences de capital supplémentaire déjà définies	R0210	0
<b>Capital de solvabilité requis</b>	<b>R0220</b>	<b>17 485</b>
<b>Autres informations sur le SCR</b>		
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	0
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

## GB Life Luxembourg

### S.28.01.01 - 01

Minimum de capital requis (MCR) - Activité d'assurance ou de réassurance vie uniquement ou activité d'assurance ou de réassurance non-vie  
 Terme de la formule linéaire pour les engagements d'assurance et de réassurance

		C0040
Résultat MCRL	R0200	16 159

		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	39 217	
Engagements avec participation aux bénéfices - Prestations discrétionnaires futures	R0220	0	
Engagements d'assurance avec prestations indexées et en unités de compte	R0230	2 086 757	
Autres engagements de (ré)assurance vie et de (ré)assurance santé	R0240	3 429	
Montant total du capital sous risque pour tous les engagements de (ré)assurance vie	R0250		41 600

### Calcul du MCR global

		C0070
MCR linéaire	R0300	16 159
Capital de solvabilité requis	R0310	17 485
Plafond du MCR	R0320	7 868
Plancher du MCR	R0330	4 371
MCR combiné	R0340	7 868
Seuil plancher absolu du MCR	R0350	3 700
Minimum de capital requis	R0400	7 868