

Foyer Luxembourg Ré S.A.

S.02.01.02

Bilan

		Valeur Solvabilité II
		C0010
Actifs		
Immobilisations incorporelles	R0030	
Actifs d'impôts différés	R0040	
Excédent du régime de retraite	R0050	
Immobilisations corporelles détenues pour usage propre	R0060	
Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés)	R0070	50.064
Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre)	R0080	
Détenions dans des entreprises liées, y compris participations	R0090	
Actions	R0100	5.091
Actions - cotées	R0110	5.091
Actions - non cotées	R0120	
Obligations	R0130	41.300
Obligations d'État	R0140	16.731
Obligations d'entreprise	R0150	19.756
Titres structurés	R0160	4.813
Titres garantis	R0170	
Organismes de placement collectif	R0180	3.672
Produits dérivés	R0190	
Dépôts autres que les équivalents de trésorerie	R0200	
Autres investissements	R0210	
Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés	R0220	
Prêts et prêts hypothécaires	R0230	0
Avances sur police	R0240	
Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers	R0250	
Autres prêts et prêts hypothécaires	R0260	
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	
Santé similaire à la non-vie	R0300	
Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés	R0310	0
Santé similaire à la vie	R0320	
Vie hors santé, UC et indexés	R0330	
Vie UC et indexés	R0340	
Dépôts auprès des cédantes	R0350	
Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires	R0360	
Créances nées d'opérations de réassurance	R0370	3.579
Autres créances (hors assurance)	R0380	30
Actions propres auto-détenues (directement)	R0390	
Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s)	R0400	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	R0410	5.020
Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus	R0420	
Total de l'actif	R0500	58.692

Foyer Luxembourg Ré S.A.

S.02.01.02

Bilan

		Valeur Solvabilité II
		C0010
Passifs		
Provisions techniques non-vie	R0510	-12.732
Provisions techniques non-vie (hors santé)	R0520	-12.732
Provisions techniques calculées comme un tout	R0530	
Meilleure estimation	R0540	-13.694
Marge de risque	R0550	962
Provisions techniques santé (similaire à la non-vie)	R0560	0
Provisions techniques calculées comme un tout	R0570	
Meilleure estimation	R0580	
Marge de risque	R0590	
Provisions techniques vie (hors UC et indexés)	R0600	0
Provisions techniques santé (similaire à la vie)	R0610	0
Provisions techniques calculées comme un tout	R0620	
Meilleure estimation	R0630	
Marge de risque	R0640	
Provisions techniques vie (hors santé, UC et indexés)	R0650	0
Provisions techniques calculées comme un tout	R0660	
Meilleure estimation	R0670	
Marge de risque	R0680	
Provisions techniques UC et indexés	R0690	0
Provisions techniques calculées comme un tout	R0700	
Meilleure estimation	R0710	
Marge de risque	R0720	
Passifs éventuels	R0740	
Provisions autres que les provisions techniques	R0750	26
Provisions pour retraite	R0760	
Dépôts des réassureurs	R0770	
Passifs d'impôts différés	R0780	16.555
Produits dérivés	R0790	
Dettes envers des établissements de crédit	R0800	
Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit	R0810	
Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires	R0820	
Dettes nées d'opérations de réassurance	R0830	
Autres dettes (hors assurance)	R0840	20
Passifs subordonnés	R0850	0
Passifs subordonnés non inclus dans les fonds propres de base	R0860	
Passifs subordonnés inclus dans les fonds propres de base	R0870	
Autres dettes non mentionnées dans les postes ci-dessus	R0880	
Total du passif	R0900	3.869
Excédent d'actif sur passif	R1000	54.823

Foyer Luxembourg Ré S.A.

S.17.01.02

Provisions techniques non-vie

		Assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée											Réassurance non proportionnelle acceptée				Total engagements en non-vie	
		Assurance des frais médicaux	Assurance de protection du revenu	Assurance d'indemnisation des travailleurs	Assurance de responsabilité civile automobile	Autre assurance des véhicules à moteur	Assurance maritime, aérienne et transport	Assurance incendie et autres dommages aux biens	Assurance de responsabilité civile générale	Assurance crédit et cautionnement	Assurance de protection juridique	Assistance	Pertes pécuniaires diverses	Réassurance santé non proportionnelle	Réassurance accidents non proportionnelle	Réassurance maritime, aérienne et transport non proportionnelle		Réassurance dommages non proportionnelle
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	C0110	C0120	C0130	C0140	C0150	C0160		C0170
Provisions techniques calculées comme un tout	R0010	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
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	R0050																	0
Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque																		
Meilleure estimation																		
<i>Provisions pour primes</i>																		
Brut - total	R0060	0	0	0	0	0	0	-5.082	0	0	0	0	0	0	-5.074	-177	-3.361	-13.694
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	R0140																	0
Meilleure estimation nette des provisions pour primes	R0150	0	0	0	0	0	0	-5.082	0	0	0	0	0	0	-5.074	-177	-3.361	-13.694
<i>Provisions pour sinistres</i>																		
Brut - total	R0160	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
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	R0240																	0
Meilleure estimation nette des provisions pour sinistres	R0250	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total meilleure estimation - brut	R0260	0	0	0	0	0	0	-5.082	0	0	0	0	0	0	-5.074	-177	-3.361	-13.694
Total meilleure estimation - net	R0270	0	0	0	0	0	0	-5.082	0	0	0	0	0	0	-5.074	-177	-3.361	-13.694
Marge de risque	R0280	0	0	0	0	0	0	357	0	0	0	0	0	0	356	12	236	962
Provisions techniques - Total																		
Provisions techniques - Total	R0320	0	0	0	0	0	0	-4.725	0	0	0	0	0	0	-4.718	-164	-3.125	-12.732
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 - total	R0330	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Provisions techniques nettes des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie	R0340	0	0	0	0	0	0	-4.725	0	0	0	0	0	0	-4.718	-164	-3.125	-12.732

Foyer Luxembourg Ré S.A.

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	-12.732	0	0	-13	0
Fonds propres de base	R0020	54.823	0	0	10	0
Fonds propres éligibles pour couvrir le SCR	R0050	54.823	0	0	10	0
Capital de solvabilité requis	R0090	13.879	0	0	0	0
Fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0100	54.823	0	0	10	0
Minimum de capital requis	R0110	3.900	0	0	0	0

Foyer Luxembourg Ré S.A.

S.23.01.01 - 01

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, comme prévu à l'article 68 du règlement délégué 2015/35						
Capital en actions ordinaires (brut des actions propres)	R0010	5.000	5.000			
Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires	R0030	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				
Comptes mutualistes subordonnés	R0050	0				
Fonds excédentaires	R0070	0				
Actions de préférence	R0090	0				
Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence	R0110	0				
Réserve de réconciliation	R0130	49.823	49.823			
Passifs subordonnés	R0140	0				
Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets	R0160	0				
Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra	R0180	0				
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					
Déductions						
Déductions pour participations dans des établissements de crédit et des établissements financiers	R0230	0				
Total fonds propres de base après déductions	R0290	54.823	54.823	0	0	0
Fonds propres auxiliaires						
Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande	R0300	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				
Actions de préférence non libérées et non appelées, callable sur demande	R0320	0				
Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande	R0330	0				
Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	R0340	0				
Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	R0350	0				
Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE	R0360	0				
Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE	R0370	0				
Autres fonds propres auxiliaires	R0390	0				
Total fonds propres auxiliaires	R0400	0			0	0
Fonds propres éligibles et disponibles						
Total des fonds propres disponibles pour couvrir le capital de solvabilité requis	R0500	54.823	54.823	0	0	0
Total des fonds propres disponibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0510	54.823	54.823	0	0	
Total des fonds propres éligibles pour couvrir le capital de solvabilité requis	R0540	54.823	54.823			
Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0550	54.823	54.823			
Capital de solvabilité requis	R0580	13.879				
Minimum de capital requis	R0600	3.900				
Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis	R0620	3,95				
Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital requis	R0640	14,06				

Foyer Luxembourg Ré S.A.

S.23.01.01 - 02

Fonds propres

		C0060
Réserve de réconciliation		
Excédent d'actif sur passif	R0700	54.823
Actions propres (détenues directement et indirectement)	R0710	
Dividendes, distributions et charges prévisibles	R0720	
Autres éléments de fonds propres de base	R0730	5.000
Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux portefeuilles sous ajustement égalisateur et aux fonds cantonnés	R0740	
Réserve de réconciliation	R0760	49.823
Bénéfices attendus		
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) - activités vie	R0770	
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) - activités non-vie	R0780	13.694
Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP)	R0790	13.694

Foyer Luxembourg Ré S.A.

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	5.742		
Risque de défaut de la contrepartie	R0020	803		
Risque de souscription en vie	R0030			
Risque de souscription en santé	R0040	0		
Risque de souscription en non-vie	R0050	15.225		
Diversification	R0060	-3.779		
Risque lié aux immobilisations incorporelles	R0070			
Capital de solvabilité requis de base	R0100	17.990		

Calcul du capital de solvabilité requis

		C0100
Risque opérationnel	R0130	500
Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques	R0140	
Capacité d'absorption des pertes des impôts différés	R0150	-4.612
Capital requis pour les activités exercées conformément à l'article 4 de la directive 2003/41/CE	R0160	
Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire	R0200	13.879
Exigences de capital supplémentaire déjà définies	R0210	0
Capital de solvabilité requis	R0220	13.879
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	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

Approach to tax rate

		C0109
Approche basée sur le taux d'imposition moyen	R0590	1

Calculation of loss absorbing capacity of deferred taxes

		C0130
LAC DT	R0640	-4.612
LAC DT justifiée par la reprise de passifs d'impôts différés	R0650	-4.612
LAC DT justifiée au regard de probables bénéfices économiques imposables futur	R0660	0
LAC DT justifiée par le report en arrière, exercice en cours	R0670	0
LAC DT justifiée par le report en arrière, exercices futurs	R0680	0
LAC DT maximale	R0690	-16.555

Foyer Luxembourg Ré S.A.

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 non-vie

		C0010	
Résultat MCRNL	R0010	1.874	
			Meilleure estimation et PT calculées comme un tout, nettes (de la réassurance/des véhicules de titrisation)
			Primes émises au cours des 12 derniers mois, nettes (de la réassurance)
		C0020	C0030
Assurance frais médicaux et réassurance proportionnelle y afférente	R0020		
Assurance de protection du revenu, y compris réassurance proportionnelle y afférente	R0030		
Assurance indemnisation des travailleurs et réassurance proportionnelle y afférente	R0040		
Assurance de responsabilité civile automobile et réassurance proportionnelle y afférente	R0050		
Autre assurance des véhicules à moteur et réassurance proportionnelle y afférente	R0060		
Assurance maritime, aérienne et transport et réassurance proportionnelle y afférente	R0070		
Assurance incendie et autres dommages aux biens et réassurance proportionnelle y afférente	R0080		6.337
Assurance de responsabilité civile générale et réassurance proportionnelle y afférente	R0090		
Assurance crédit et cautionnement et réassurance proportionnelle y afférente	R0100		
Assurance de protection juridique et réassurance proportionnelle y afférente	R0110		
Assurance assistance et réassurance proportionnelle y afférente	R0120		
Assurance pertes pécuniaires diverses et réassurance proportionnelle y afférente	R0130		
Réassurance santé non proportionnelle	R0140		
Réassurance accidents non proportionnelle	R0150		5.200
Réassurance maritime, aérienne et transport non proportionnelle	R0160		187
Réassurance dommages non proportionnelle	R0170		3.413

Terme de la formule linéaire pour les engagements d'assurance et de réassurance vie

		C0040	
Résultat MCRL	R0200	0	
			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		
Engagements avec participation aux bénéfices - Prestations discrétionnaires futures	R0220		
Engagements d'assurance avec prestations indexées et en unités de compte	R0230		
Autres engagements de (ré)assurance vie et de (ré)assurance santé	R0240		
Montant total du capital sous risque pour tous les engagements de (ré)assurance vie	R0250		

Calcul du MCR global

		C0070
MCR linéaire	R0300	1.874
Capital de solvabilité requis	R0310	13.879
Plafond du MCR	R0320	6.246
Plancher du MCR	R0330	3.470
MCR combiné	R0340	3.470
Seuil plancher absolu du MCR	R0350	3.900
Minimum de capital requis	R0400	3.900