



X^L Insurance

Modèles de déclaration quantitative 2018

Annexe I

S.02.01.02

Bilan (en millions d'euros)

	Valeur Solvabilité II C0010
Actif	
Immobilisations incorporelles	R0030 0
Actifs d'impôts différés	R0040 19
Excédent du régime de retraite	R0050 0
Immobilisations corporelles détenues pour usage propre	R0060 9
Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre)	R0070 5 262
Détentions dans des entreprises liées, y compris participations	R0080 0
Actions	R0090 114
Actions – cotées	R0100 139
Actions – non cotées	R0110 138
Obligations	R0120 1
Obligations d'État	R0130 3 341
Obligations d'entreprise	R0140 1 812
Titres structurés	R0150 1 367
Titres garantis	R0160 0
Organismes de placement collectif	R0170 162
Produits dérivés	R0180 1 646
Dépôts autres que les équivalents de trésorerie	R0190 23
Autres investissements	R0200 0
Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés	R0210 0
Prêts et prêts hypothécaires	R0220 0
Avances sur police	R0230 190
Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers	R0240 0
Autres prêts et prêts hypothécaires	R0250 0
Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance	R0260 190
Non-vie et santé similaire à la non-vie	R0270 1 840
Non-vie hors santé	R0280 1 840
Santé similaire à la non-vie	R0290 1 840
Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés	R0300 0
Santé similaire à la vie	R0310 0
Vie hors santé, UC et indexés	R0320 0
Vie UC et indexés	R0330 0
Dépôts auprès des cédantes	R0340 0
Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires	R0350 94
Créances nées d'opérations de réassurance	R0360 1 465
Autres créances (hors assurance)	R0370 170
Actions propres auto-détenues (directement)	R0380 219
Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s)	R0390 0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	R0400 0
Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus	R0410 391
	R0420 63
Total de l'actif	R0500 9 723

Annexe I

S.02.01.02

Bilan (en millions d'euros)

	Valeur Solvabilité II	
	C0010	
Passif		
Provisions techniques non-vie	R0510	5 882
Provisions techniques non-vie (hors santé)	R0520	5 882
Provisions techniques calculées comme un tout	R0530	0
Meilleure estimation	R0540	5 632
Marge de risque	R0550	250
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	61
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	61
Provisions techniques calculées comme un tout	R0660	0
Meilleure estimation	R0670	57
Marge de risque	R0680	4
Provisions techniques UC et indexés	R0690	0
Provisions techniques calculées comme un tout	R0700	0
Meilleure estimation	R0710	0
Marge de risque	R0720	0
Passifs éventuels	R0740	0
Provisions autres que les provisions techniques	R0750	6
Provisions pour retraite	R0760	39
Dépôts des réassureurs	R0770	48
Passifs d'impôts différés	R0780	202
Produits dérivés	R0790	0
Dettes envers des établissements de crédit	R0800	0
Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit	R0810	641
Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires	R0820	331
Dettes nées d'opérations de réassurance	R0830	613
Autres dettes (hors assurance)	R0840	238
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	129
Total du passif	R0900	8 189
Excédent d'actif sur passif	R1000	1 533

Annexe I

S.05.01.02

Primes, sinistres et dépenses par ligne d'activité (en millions d'euros)

	Ligne d'activité pour: engagements d'assurance et de réassurance non-vie (assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée)						Ligne d'activité pour: réassurance non proportionnelle acceptée					Total
	Assurance de protection juridique	Assistance	Pertes pécuniaires diverses	Santé	Accidents	Assurance maritime, aérienne et transport	Biens					
	C0100	C0110	C0120	C0130	C0140	C0150	C0160	C0200				
Primes émises												
Brut – assurance directe	0	0	39					1 515				
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	0	0	22					906				
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée					0	-4	9	6				
Part des réassureurs	0	0	14		-1	-5	18	1 055				
Net	0	0	47		1	2	-9	1 372				
Primes acquises												
Brut – assurance directe	0	0	45					1 461				
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	0	0	22					844				
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée					0	-4	18	15				
Part des réassureurs	0	0	16		4	-5	31	1 057				
Net	0	0	51		-4	2	-13	1 262				
Charge des sinistres												
Brut – assurance directe	0	0	8					906				
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	0	0	4					601				
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée					0	3	9	12				
Part des réassureurs	0	0	-1		0	-4	3	622				
Net	0	0	13		0	7	6	897				
Variation des autres provisions techniques												
Brut – assurance directe	0	0	-1					-5				
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	0	0	0					5				
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée												
Part des réassureurs	0	0	-1									
Net	0	0	0		0	0	0	1				
Dépenses engagées	0	0	7		0	2	1	354				
Autres dépenses								0				
Total des dépenses								354				

Annexe I
S.05.01.02

Primes, sinistres et dépenses par ligne d'activité (en millions d'euros)

	Ligne d'activité pour: engagements d'assurance vie							Engagements de réassurance vie		Total
	C0210	C0220	C0230	C0240	C0250	C0260	C0270	C0280	C0300	
Primes émises										
Brut	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Part des réassureurs	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Net	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Primes acquises										
Brut	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Part des réassureurs	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Net	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Charge des sinistres										
Brut	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-3
Part des réassureurs	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Net	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-3
Variation des autres provisions techniques										
Brut	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2
Part des réassureurs	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Net	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2
Dépenses engagées	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Autres dépenses										0
Total des dépenses										0

Annexe I

S.05.02.01

Primes, sinistres et dépenses par pays (en millions d'euros)

	Pays d'origine	5 principaux pays (par montant de primes brutes émises) – engagements en non-vie					Total 5 principaux pays et pays d'origine	
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070
		C0080	C0090	C0100	C0110	C0120	C0130	C0140
R0010		DE	GB	CH	IT			
		C0080	C0090	C0100	C0110	C0120	C0130	C0140
Primes émises								
Brut – assurance directe	R0110	628	249	185	30	35	0	1 126
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	R0120	243	128	87	40	33	0	530
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée	R0130	2	4	-11	1	0	0	-5
Part des réassureurs	R0140	308	100	76	31	9	0	524
Net	R0200	566	280	184	40	59	0	1 128
Primes acquises								
Brut – assurance directe	R0210	611	232	177	31	45	0	1 097
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	R0220	235	135	76	38	30	0	515
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée	R0230	2	4	8	0	0	0	15
Part des réassureurs	R0240	307	114	85	30	18	0	554
Net	R0300	542	257	177	39	58	0	1 073
Charge des sinistres								
Brut – assurance directe	R0310	179	159	108	-1	85	0	530
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	R0320	75	67	75	28	30	0	276
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée	R0330	0	5	-19	2	0	0	-12
Part des réassureurs	R0340	142	40	58	10	28	0	279
Net	R0400	112	192	106	19	87	0	515
Variation des autres provisions techniques								
Brut – assurance directe	R0410	-5	0	0	0	0	0	-5
Brut – Réassurance proportionnelle acceptée	R0420	2	0	0	0	0	0	2
Brut – Réassurance non proportionnelle acceptée	R0430	0	0	0	0	0	0	0
Part des réassureurs	R0440	0	0	0	0	0	0	0
Net	R0500	-3	0	0	0	0	0	-3
Dépenses engagées	R0550	194	88	39	3	8	0	331
Autres dépenses	R1200							0
Total des dépenses	R1300							331

Annexe I

S.05.02.01

Primes, sinistres et dépenses par pays (en millions d'euros)

	Pays d'origine	5 principaux pays (par montant de primes brutes émises) – engagements en non-vie					Total 5 principaux pays et pays d'origine	
		C0150	C0160	C0170	C0180	C0190	C0200	C0210
		C0220	C0230	C0240	C0250	C0260	C0270	C0280
R1400		DE	GB	IT	CH			
Primes émises								
Brut	R1410	0	0	0	0	0	0	
Part des réassureurs	R1420	0	0	0	0	0	0	
Net	R1500	0	0	0	0	0	0	
Primes acquises								
Brut	R1510	0	0	0	0	0	0	
Part des réassureurs	R1520	0	0	0	0	0	0	
Net	R1600	0	0	0	0	0	0	
Charge des sinistres								
Brut	R1610	0	0	0	0	0	0	
Part des réassureurs	R1620	0	0	0	0	0	0	
Net	R1700	0	0	0	0	0	0	
Variation des autres provisions techniques								
Brut	R1710	0	0	0	0	0	0	
Part des réassureurs	R1720	0	0	0	0	0	0	
Net	R1800	0	0	0	0	0	0	
Dépenses engagées	R1900	0	0	0	0	0	0	
Autres dépenses	R2500						0	
Total des dépenses	R2600						0	

Annexe I

S.12.01.02

Provisions techniques vie et santé SLT (en millions d'euros)

	Assurance avec participation aux bénéfices		Assurance indexée et en unités de compte				Autres assurances vie			Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie acceptés et liés aux engagements d'assurance autres que les engagements d'assurance santé	Réassurance acceptée	Total (vie hors santé, y compris UC)
	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100			
R0010	0	0			0				0	0	0	
R0020	0	0			0			0	0	0	0	
R0030	0	0			0			0	0	57	57	
R0080	0	0			0			0	0	0	0	
R0090	0	0			0			0	0	57	57	
R0100	0	0			0			0	0	4	4	
R0110	0	0			0			0	0	0	0	
R0120	0	0			0			0	0	0	0	
R0130	0	0			0			0	0	0	0	
R0200	0	0			0			0	0	61	61	

Provisions techniques calculées comme un tout

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

Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque

Meilleure estimation

Meilleure estimation brute

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

Meilleure estimation nette des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite

Marge de risque

Montant de la déduction transitoire sur les provisions techniques

Provisions techniques calculées comme un tout

Meilleure estimation

Marge de risque

Provisions techniques – Total

Annexe I
S.12.01.02
Provisions techniques vie et santé SLT (en millions d'euros)

	Assurance santé (assurance directe)				C0190	C0200	C0210	
	Rentes découlant des contrats d'assurance non-vie et liées aux engagements d'assurance santé		Rassurance santé (réassurance acceptée)					Total (santé similaire à la vie)
	C0160	C0170	C0180	C0190				
Provisions techniques calculées comme un tout	R0210							
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	0			0	0	0	0	
Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque	R0220			0	0	0	0	
Meilleure estimation								
Meilleure estimation brute	R0030			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	0	0	0	0	0	0	0	
Meilleure estimation nette des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie – total	R0090			0	0	0	0	
Marge de risque	R0100			0	0	0	0	
Montant de la déduction transitoire sur les provisions techniques								
Provisions techniques calculées comme un tout	R0110			0	0	0	0	
Meilleure estimation	R0120			0	0	0	0	
Marge de risque	R0130			0	0	0	0	
Provisions techniques – Total	R0200			0	0	0	0	

Annexe I

S.17.01.02

Provisions techniques non-vie (en millions d'euros)

Assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée										
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 de crédit et cautionnement		
C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100		
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0010										
Provisions techniques calculées comme un tout										
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										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0050										
Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque										
Meilleure estimation										
Provisions pour primes										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0060										
Meilleure estimation										
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										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0140										
Meilleure estimation nette des provisions pour primes										
Provisions pour sinistres										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0150										
Provisions pour sinistres										
0	0	0	249	104	900	1 361	2 143	0		
R0160										
Meilleure estimation										
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										
0	0	0	29	16	288	621	574	0		
R0240										
Meilleure estimation										
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										
0	0	0	219	88	612	740	1 570	0		
R0250										
Total meilleure estimation – brut										
0	0	0	256	109	1 011	1 772	2 267	2		
R0260										
Total meilleure estimation – net										
0	0	0	228	93	686	957	1 641	-0		
R0270										
Marge de risque										
0	0	0	15	6	46	62	109	0		
R0280										
Montant de la déduction transitoire sur les provisions										
Provisions techniques calculées comme un tout										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0290										
Meilleure estimation										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0300										
Marge de risque										
0	0	0	0	0	0	0	0	0		
R0310										

Annexe I

S.17.01.02

Provisions techniques non-vie (en millions d'euros)

Assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée									
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	
C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	
0	0	0	271	115	1 056	1 834	2 376	2	
0	0	0	28	16	325	815	626	2	
0	0	0	243	100	732	1 018	1 749	0	

Provisions techniques – Total

Provisions techniques – Total

R0320

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

Provisions techniques nettes des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finie

R0340

Annexe I
S.17.01.02
Provisions techniques non-vie (en millions d'euros)

	Assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée			Réassurance non proportionnelle acceptée					Total engagements en non-vie
	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	C0180	
R0010	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Provisions techniques calculées comme un tout									
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	0	0	0	0	0	0	0	0	0
R0050									
Provisions techniques calculées comme la somme de la meilleure estimation et de la marge de risque									
Meilleure estimation									
Provisions pour primes									
Brut	0	0	6	0	0	0	0	0	666
R0060									
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	0	0	3	0	0	0	0	0	287
R0140									
Meilleure estimation nette des provisions pour primes									
Provisions pour sinistres									
Brut	0	0	4	0	0	0	0	0	379
R0150									
Provisions pour sinistres									
Brut	0	0	209	0	0	0	0	0	4 967
R0160									
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	0	0	25	0	0	0	0	0	1 553
R0240									
Meilleure estimation nette des provisions pour sinistres									
Brut	0	0	184	0	0	0	0	0	3 414
R0250									
Total meilleure estimation – brut	0	0	215	0	0	0	0	0	5 632
R0260									
Total meilleure estimation – net	0	0	188	0	0	0	0	0	3 792
R0270									
Marge de risque	0	0	12	0	0	0	0	0	250
R0280									
Montant de la déduction transitoire sur les provisions									
Provisions techniques calculées comme un tout	0	0	0	0	0	0	0	0	0
R0290									
Meilleure estimation	0	0	0	0	0	0	0	0	0
R0300									
Marge de risque	0	0	0	0	0	0	0	0	0
R0310									

Annexe I

S.17.01.02

Provisions techniques non-vie (en millions d'euros)

	Assurance directe et réassurance proportionnelle acceptée			Réassurance non proportionnelle acceptée					Total engagements en non-vie
	Assurance de protection juridique C0110	Assistance C0120	Pertes pécuniaires diverses C0130	Réassurance santé non proportionnelle C0140	Réassurance accidents non proportionnelle C0150	Réassurance maritime, aérienne et transport non proportionnelle C0160	Réassurance dommages non proportionnelle C0170	C0180	
R0320	0	0	228	0	0	0	0	0	5 882
R0330	0	0	28	0	0	0	0	0	1 840
R0340	0	0	200	0	0	0	0	0	4 042

Provisions techniques – Total

Provisions techniques – Total

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 – total

Provisions techniques nettes des montants recouvrables au titre de la réassurance/des véhicules de titrisation et de la réassurance finite

Sinistres en non-vie (en millions d'euros)

Année d'accident / année de souscription	Z0020	Année de souscription
--	-------	-----------------------

Sinistres payés bruts (non cumulés)
(valeur absolue)

Précédentes	Année	Année de développement										Somme des années (cumulés)	
		0	1	2	3	4	5	6	7	8	9		10 & +
	R0100	C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	C0110	C0180
N-9	58	205	88	33	13	13	5	5	1	2	5 297	5 297	5 297
N-8	56	202	97	27	13	7	3	5	2				425
N-7	57	194	122	26	18	12	4	6					414
N-6	66	210	120	45	13	11	4						439
N-5	65	207	91	71	23	12							469
N-4	78	172	112	36	16								470
N-3	74	316	209	63									413
N-2	48	191	88										661
N-1	64	170											327
N	51												235
													51
													9 200
													5 710
													5 297
													425
													414
													439
													469
													470
													413
													661
													327
													235
													51
													9 200

Total

Sinistres en non-vie (en millions d'euros)

Meilleure estimation provisions pour sinistres brutes non actualisées

(valeur absolue)

Précédentes	Année de développement										Fin d'année (données actualisées)		
	Année	0	1	2	3	4	5	6	7	8		9	10 & +
R0100	C0200	C0210	C0220	C0230	C0240	C0250	C0260	C0270	C0280	C0290	C0300	R0100	C0360
N-9	119	183	117	67	43	26	20	14	6	6	80	R0160	0
N-8	103	243	111	65	25	17	13	6	3			R0170	0
N-7	457	307	111	50	37	27	18	10				R0180	0
N-6	457	246	119	60	53	32	14					R0190	0
N-5	433	261	171	87	58	49						R0200	0
N-4	414	238	106	64	39							R0210	0
N-3	541	344	143	48								R0220	0
N-2	403	209	85									R0230	0
N-1	407	228										R0240	0
N	430											R0250	0
												R0260	0
													Total

Annexe I

S.22.01.21

Impact des mesures relatives aux garanties de long terme et des mesures transitoires (en millions d'euros)

	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 5 944	-	-	62	-
Fonds propres de base	R0020 1 398	-	-	-	-
Fonds propres éligibles pour couvrir le SCR	R0050 1 398	-	-	-	-
Capital de solvabilité requis	R0090 973	-	-	-	-
Fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis	R0100 1 379	-	-	-	-
Minimum de capital requis	R0110 438	-	-	-	-

Annexe I
S.23.01.01
Fonds propres (en millions d'euros)

	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)	190	190		0	
Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires	83	83		0	
Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de base équivalent pour les mutuelles et les entreprises de type mutuel	0	0		0	
Comptes mutualistes subordonnés	0		0	0	0
Fonds excédentaires	0	0			
Actions de préférence	0		0	0	0
Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence	0		0	0	0
Réserve de réconciliation	1 106	1 106			
Passifs subordonnés	0		0	0	0
Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets	19				19
Autres éléments de fonds propres approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds propres de base non spécifiés supra	0	0	0	0	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	0				
Déductions					
Déductions pour participations dans des établissements de crédit et des établissements financiers	0	0	0	0	0
Total fonds propres de base après déductions	1 398	1 379	0	0	19
Fonds propres auxiliaires					
Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur demande	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	0			0	
Actions de préférence non libérées et non appelées, appelables sur demande	0			0	
Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des passifs subordonnés sur demande	0			0	
Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	0			0	
Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2, de la directive 2009/138/CE	0			0	
Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive 2009/138/CE	0			0	
Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3, de la directive 2009/138/CE	0			0	
Autres fonds propres auxiliaires	0			0	
Total fonds propres auxiliaires	0			0	

Annexe I
S.23.01.01
Fonds propres (en millions d'euros)

Fonds propres éligibles et disponibles

Total des fonds propres disponibles pour couvrir le capital de solvabilité requis
 Total des fonds propres disponibles pour couvrir le minimum de capital requis
 Total des fonds propres éligibles pour couvrir le capital de solvabilité requis
 Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital requis

Capital de solvabilité requis

Minimum de capital requis

Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis

Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital requis

	Total	Niveau 1 – non restreint	Niveau 1 – restreint	Niveau 2	Niveau 3
R0500	1 398	1 379	0	0	19
R0510	1 379	1 379	0	0	19
R0540	1 398	1 379	0	0	19
R0550	1 379	1 379	0	0	19
R0580	973				
R0600	438				
R0620	1,44				
R0640	3,15				

	C0060
R0700	1 533
R0710	
R0720	135
R0730	292
R0740	
R0760	1 106
R0770	
R0780	11
R0790	11

Réserve de réconciliation

Excédent d'actif sur passif

Actions propres (détenues directement et indirectement)

Dividendes, distributions et charges prévisibles

Autres éléments de fonds propres de base

Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux portefeuilles sous ajustement égalisateur et aux fonds cantonnés

Réserve de réconciliation

Bénéfices attendus

Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités vie

Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités non-vie

Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP)

Annexe I

S.25.03.21

Capital de solvabilité requis – pour les entreprises qui utilisent un modèle interne intégral (en millions d'euros)

Numéro d'identification unique du composant	Description des composants		Calcul du capital de solvabilité requis
	C0010	C0030	
1	MARKET	308	
2	CREDIT	202	
3	LIFE INSURANCE	7	
4	P&C INSURANCE	922	
5	OPERATIONAL RISK	80	
6	TAX ADJUSTMENT	-202	

Calcul du capital de solvabilité requis

Total des composants non diversifiés

Diversification

Capital requis pour les activités exercées conformément à l'article 4 de la directive 2003/41/CE (à titre transitoire)

Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire

Exigences de capital supplémentaire déjà définies

Capital de solvabilité requis

Autres informations sur le SCR

Montant/estimation de la capacité globale d'absorption des pertes des provisions techniques

Montant/estimation de la capacité globale d'absorption des pertes des impôts différés

Total du capital de solvabilité requis notionnel pour la part restante

Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les fonds cantonnés

Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les portefeuilles sous ajustement égalisateur

Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304

C0100		
R0110		1 519
R0060		-344
R0160		973
R0200		973
R0210		0
R0220		973
R0300		0
R0310		-202
R0410		0
R0420		0
R0430		0
R0440		0

Annexe I

S.28.01.01

Minimum de capital requis (MCR) – Activité d'assurance ou de réassurance vie uniquement ou activité d'assurance ou de réassurance non-vie uniquement (en millions d'euros)

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

RésultatMCRNL	C0010		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)
	R0010	560		
			C0020	C0030
Assurance frais médicaux et réassurance proportionnelle y	R0020	0	0	0
Assurance de protection du revenu, y compris réassurance proportionnelle y afférente	R0030	0	0	0
Assurance indemnisation des travailleurs et réassurance proportionnelle y afférente	R0040	0	0	0
Assurance de responsabilité civile automobile et réassurance proportionnelle y afférente	R0050	228	110	
Autre assurance des véhicules à moteur et réassurance proportionnelle y afférente	R0060	93	67	
Assurance maritime, aérienne et transport et réassurance proportionnelle y afférente	R0070	687	511	
Assurance incendie et autres dommages aux biens et réassurance proportionnelle y afférente	R0080	958	413	
Assurance de responsabilité civile générale et réassurance proportionnelle y afférente	R0090	1 642	347	
Assurance crédit et cautionnement et réassurance proportionnelle y afférente	R0100	0	0	
Assurance de protection juridique et réassurance proportionnelle y afférente	R0110	0	0	
Assurance assistance et réassurance proportionnelle y afférente	R0120	0	0	
Assurance pertes pécuniaires diverses et réassurance proportionnelle y afférente	R0130	188	44	
Réassurance santé non proportionnelle	R0140	0	0	
Réassurance accidents non proportionnelle	R0150	0	0	
Réassurance maritime, aérienne et transport non proportionnelle	R0160	0	0	
Réassurance dommages non proportionnelle	R0170	0	0	

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

RésultatMCRV	C0040		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)
	R0200	1		
			C0050	C0060
Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations garanties	R0210	0		
Engagements avec participation aux bénéfices – Prestations discrétionnaires futures	R0220	0		
Engagements d'assurance avec prestations indexées et en unités de compte	R0230	0		
Autres engagements de (ré)assurance vie et de (ré)assurance santé	R0240	57		
Montant total du capital sous risque pour tous les engagements de (ré)assurance vie	R0250			0

Calcul du MCR global

	C0070	
MCR linéaire	R0300	561
Capital de solvabilité requis	R0310	973
Plafond du MCR	R0320	438
Plancher du MCR	R0330	243
MCR combiné	R0340	438
Seuil plancher absolu du MCR	R0350	3
		C0070
Minimum de capital requis	R0400	438



axaxl.com

AXA Corporate Solutions
61 Rue Mstislav Rostropovitch
75832, Paris Cedex 17
France