

Modelo SE.02.01

Ejercicio 2019

ACTIVO		Valor Solvencia II	Valor contable	Ajustes por reclasificación
Fondo de comercio	R0010		0,00	
Comisiones anticipadas y otros costes de adquisición	R0020		0,00	
Inmovilizado intangible	R0030	0,00	15,26	0,00
Activos por impuesto diferido	R0040	9.215,02	222,76	0,00
Activos y derechos de reembolso por retribuciones a largo plazo al personal	R0050	0,00	0,00	0,00
Inmovilizado material para uso propio	R0060	15.224,42	9.830,58	0,00
Inversiones (distintas de los activos que se posean para contratos "index-linked" y "unit-linked")	R0070	109.184,16	98.882,14	0,00
Inmuebles (ajenos a los destinados al uso propio)	R0080	31.383,68	21.240,01	0,00
Participaciones	R0090	0,00	0,00	0,00
Acciones	R0100	4.935,91	4.935,91	0,00
Acciones - cotizadas	R0110	3.878,57	3.878,57	0,00
Acciones - no cotizadas	R0120	1.057,34	1.057,34	0,00
Bonos	R0130	12.802,41	12.644,05	0,00
Deuda pública	R0140	374,14	352,47	0,00
Deuda privada	R0150	12.428,27	12.291,58	0,00
Activos financieros estructurados	R0160	0,00	0,00	0,00
Titulaciones de activos	R0170	0,00	0,00	0,00
Fondos de inversión	R0180	60.062,16	60.062,16	0,00
Derivados	R0190	0,00	0,00	0,00
Depósitos distintos de los activos equivalentes al efectivo	R0200	0,00	0,00	0,00
Otras inversiones	R0210	0,00	0,00	0,00
Activos poseídos para contratos "index-linked" y "unit-linked"	R0220	0,00	0,00	0,00
Préstamos con y sin garantía hipotecaria	R0230	1.206,03	1.206,03	0,00
Anticipos sobre pólizas	R0240	0,00	0,00	0,00
A personas físicas	R0250	1.206,03	1.206,03	0,00
Otros	R0260	0,00	0,00	0,00
Importes recuperables del reaseguro	R0270	0,00	0,00	0,00
Seguros distintos del seguro de vida, y de salud similares a los seguros distintos del seguro de vida	R0280	0,00	0,00	
Seguros distintos del seguro de vida, excluidos los de salud	R0290	0,00	0,00	
Seguros de salud similares a los seguros distintos del seguro de vida	R0300	0,00	0,00	
Seguros de vida, y de salud similares a los de vida, excluidos los de salud y los "index-linked" y "unit-linked"	R0310	0,00	0,00	
Seguros de salud similares a los seguros de vida	R0320	0,00	0,00	
Seguros de vida, excluidos los de salud y los "index-linked" y "unit-linked"	R0330	0,00	0,00	
Seguros de vida "index-linked" y "unit-linked"	R0340	0,00	0,00	
Depósitos constituidos por reaseguro aceptado	R0350	0,00	0,00	0,00
Créditos por operaciones de seguro directo y coaseguro	R0360	352,92	352,92	0,00
Créditos por operaciones de reaseguro	R0370	0,00	0,00	0,00
Otros créditos	R0380	0,00	0,00	0,00
Acciones propias	R0390	0,00	0,00	0,00
Accionistas y mutualistas por desembolsos exigidos	R0400	0,00	0,00	0,00
Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	R0410	846,50	846,50	0,00
Otros activos, no consignados en otras partidas	R0420	64,95	114,23	0,00
<b>TOTAL ACTIVO</b>	R0500	<b>136.094,00</b>	<b>111.470,41</b>	<b>0,00</b>

(Datos en miles de Euros)

Modelo SE.02.01

Ejercicio 2019

PASIVO		Valor Solvencia II	Valor contable	Ajustes por reclasificación
Provisiones técnicas - seguros distintos del seguro de vida	R0510	687,16	1.053,44	0,00
Provisiones técnicas - seguros distintos del seguro de vida (Excluidos los de enfermedad)	R0520	344,21	569,46	
PT calculadas en su conjunto	R0530	0,00		
Mejor estimación (ME)	R0540	320,85		
Margen de riesgo (MR)	R0550	23,36		
Provisiones técnicas - seguros de salud (similares a los seguros distintos del seguro de vida)	R0560	342,95	483,98	
PT calculadas en su conjunto	R0570	0,00		
Mejor estimación (ME)	R0580	319,67		
Margen de riesgo (MR)	R0590	23,28		
Provisiones técnicas - seguros de vida (excluidos "index-linked" y "unit-linked")	R0600	84.853,05	50.338,21	0,00
Provisiones técnicas - seguros de salud (similares a los seguros de vida)	R0610	0,00	0,00	
PT calculadas en su conjunto	R0620	0,00		
Mejor estimación (ME)	R0630	0,00		
Margen de riesgo (MR)	R0640	0,00		
Provisiones técnicas - seguros de vida (excluidos los de salud y los "index-linked" y "unit-linked")	R0650	84.853,05	50.338,21	
PT calculadas en su conjunto	R0660	0,00		
Mejor estimación (ME)	R0670	84.262,03		
Margen de riesgo (MR)	R0680	591,02		
Provisiones técnicas - "index-linked" y "unit-linked"	R0690	0,00	0,00	0,00
PT calculadas en su conjunto	R0700	0,00		
Mejor estimación (ME)	R0710	0,00		
Margen de riesgo (MR)	R0720	0,00		
Otras provisiones técnicas	R0730	0,00	0,00	
Pasivo contingente	R0740	0,00	0,00	0,00
Otras provisiones no técnicas	R0750	0,00	0,00	0,00
Provisión para pensiones y obligaciones similares	R0760	0,00	0,00	0,00
Depósitos recibidos por reaseguro cedido	R0770	0,00	0,00	0,00
Pasivos por impuesto diferido	R0780	6.269,17	1.908,60	0,00
Derivados	R0790	0,00	0,00	0,00
Deudas con entidades de crédito	R0800	836,07	824,16	0,00
Deudas con entidades de crédito residentes	ER0801	836,07		0,00
Deudas con entidades de crédito residentes en el resto de la zona euro	ER0802	0,00		0,00
Deudas con entidades de crédito residentes en el resto del mundo	ER0803	0,00		0,00
Pasivos financieros distintos de las deudas con entidades de crédito	R0810	1.995,31	1.995,31	0,00
Deudas con entidades no de crédito	ER0811	1.995,31		0,00
Deudas con entidades no de crédito residentes	ER0812	1.995,31		0,00
Deudas con entidades no de crédito residentes en el resto de la zona euro	ER0813	0,00		0,00
Deudas con entidades de no crédito residentes en el resto del mundo	ER0814	0,00		0,00
Otros pasivos financieros	ER0815	0,00		0,00
Deudas por operaciones de seguro y coaseguro	R0820	294,15	294,15	0,00
Deudas por operaciones de reaseguro	R0830	0,00	0,00	0,00
Otras deudas y partidas a pagar	R0840	179,75	179,75	0,00
Pasivos subordinados	R0850	0,00	0,00	0,00
Pasivos subordinados no incluidos en los fondos propios básicos	R0860	0,00	0,00	0,00
Pasivos subordinados incluidos en los fondos propios básicos	R0870	0,00	0,00	0,00
Otros pasivos, no consignados en otras partidas	R0880	0,00	2,40	0,00
TOTAL PASIVO	R0900	95.114,65	56.596,01	0,00
EXCESO DE LOS ACTIVOS RESPECTO A LOS PASIVOS	R1000	40.979,35	54.874,40	0,00

(Datos en miles de Euros)

Modelo S.22.01  
Ejercicio 2019

IMPACTO DE LAS MEDIDAS DE GARANTÍAS A LARGO PLAZO Y LAS MEDIDAS TRANSITORIAS											
		Importe con medidas de garantías a largo plazo y medidas transitorias	Impacto de las medidas de garantías a largo plazo y las medidas transitorias (enfoque gradual)								
			Sin medida transitoria sobre las provisiones técnicas	Impacto de la medida transitoria sobre las provisiones técnicas	Sin medida transitoria sobre el tipo de interés	Impacto de la medida transitoria sobre el tipo de interés	Sin ajuste por volatilidad y sin otras medidas transitorias	Impacto del ajuste por volatilidad fijado en cero	Sin ajuste por casamiento ni todas las demás medidas transitorias	Impacto del ajuste por casamiento fijado en cero	Impacto de todas las medidas de garantías a largo plazo y las medidas transitorias
<b>Provisiones técnicas</b>	R0010	85.540,21	85.540,21	0,00	85.540,21	0,00	87.281,95	1.741,74	87.281,95	0,00	1.741,74
<b>Fondos propios básicos</b>	R0020	40.979,35	40.979,35	0,00	40.979,35	0,00	39.672,05	-1.307,30	39.672,05	0,00	-1.307,30
Excedente de los activos respecto a los pasivos	R0030	40.979,35	40.979,35	0,00	40.979,35	0,00	39.672,05	-1.307,30	39.672,05	0,00	-1.307,30
Fondos propios restringidos debido a fondos de disponibilidad limitada y carteras sujetas a ajuste por casamiento	R0040	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Fondos propios admisibles para cubrir el capital de solvencia obligatorio</b>	R0050	40.979,35	40.979,35	0,00	40.979,35	0,00	39.672,05	-1.307,30	39.672,05	0,00	-1.307,30
Nivel 1	R0060	38.033,51	38.033,51	0,00	38.033,51	0,00	36.290,45	-1.743,06	36.290,45	0,00	-1.743,06
Nivel 2	R0070	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Nivel 3	R0080	2.945,84	2.945,84	0,00	2.945,84	0,00	3.381,61	435,77	3.381,61	0,00	435,77
<b>Capital de solvencia obligatorio</b>	R0090	26.329,85	26.329,85	0,00	26.329,85	0,00	26.345,91	16,06	26.345,91	0,00	16,06
<b>Fondos propios admisibles para cubrir el capital mínimo obligatorio</b>	R0100	38.033,51	38.033,51	0,00	38.033,51	0,00	36.290,45	-1.743,06	36.290,45	0,00	-1.743,06
<b>Capital mínimo obligatorio</b>	R0110	6.582,46	6.582,46	0,00	6.582,46	0,00	6.586,48	4,02	6.586,48	0,00	4,02

(Datos en miles de Euros)

Modelo S.23.01  
Ejercicio 2019

FONDOS PROPIOS						
Fondos propios básicos		Total	Nivel 1 No restringido	Nivel 1 Restringido	Nivel 2	Nivel 3
Capital social de acciones ordinarias (incluidas las acciones propias)	R0010	9.090,00	9.090,00		0,00	
Prima de emisión de las acciones ordinarias	R0030	0,00	0,00		0,00	
Fondo mutual inicial	R0040	0,00	0,00		0,00	
Cuentas mutuales subordinadas	R0050	0,00		0,00	0,00	0,00
Fondos excedentarios	R0070	0,00	0,00			
Acciones preferentes	R0090	0,00		0,00	0,00	0,00
Primas de emisión de acciones y participaciones preferentes	R0110	0,00		0,00	0,00	0,00
Reserva de reconciliación	R0130	28.943,51	28.943,51			
Pasivos subordinados	R0140	0,00		0,00	0,00	0,00
Importe equivalente al valor de los activos por impuestos diferidos netos	R0160	2.945,84				2.945,84
Otros elementos aprobados por la autoridad supervisora como fondos propios básicos no especificados anteriormente	R0180	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Fondos propios de los estados financieros que no deben representarse mediante la reserva de reconciliación y no satisfacen los criterios para su clasificación como fondos propios de Solvencia II</b>						
Fondos propios de los estados financieros que no deben representarse mediante la reserva de reconciliación y no satisfacen los criterios para su clasificación como fondos propios de Solvencia II	R0220	0,00				
<b>Deducciones no incluidas en la reserva de reconciliación</b>						
Deducción por participaciones en entidades financieras y de crédito	R0230	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Total fondos propios básicos después de ajustes</b>	R0290	40.979,35	38.033,51	0,00	0,00	2.945,84

(Datos en miles de Euros)

Modelo S.23.01

Ejercicio 2019

FONDOS PROPIOS						
Fondos propios complementarios		Total	Nivel 1 No restringido	Nivel 1 Restringido	Nivel 2	Nivel 3
Capital social ordinario no desembolsado ni exigido	R0300	0,00			0,00	
Fondo mutual inicial no desembolsado ni exigido	R0310	0,00			0,00	
Capital social de acciones preferentes no desembolsado ni exigido	R0320	0,00			0,00	0,00
Compromiso jurídico para suscribir y pagar los pasivos subordinados a instancia del tenedor	R0330	0,00			0,00	0,00
Cartas de crédito y garantías establecidas en el artículo 96.2 de la Directiva	R0340	0,00			0,00	
Otras cartas de crédito y garantías guardadas en depósito distintas de las establecidas en el artículo 96.2 de la Directiva	R0350	0,00			0,00	0,00
Derramas futuras exigibles a las mutuas y sociedades mutualistas de navieros establecidas en el párrafo primero punto 3 del art. 96 de la Directiva 2009/138/EC	R0360	0,00			0,00	
Derramas futuras exigibles a las mutuas y sociedades mutualistas de navieros distintas a las establecidas en el párrafo primero punto 3 del art. 96 de la Directiva 2009/138/EC	R0370	0,00			0,00	0,00
Otros fondos propios complementarios	R0390	0,00			0,00	0,00
<b>Total de fondos propios complementarios</b>	R0400	0,00			0,00	0,00
Fondos propios disponibles y admisibles		Total	Nivel 1 No restringido	Nivel 1 Restringido	Nivel 2	Nivel 3
<b>Total de fondos propios disponibles para cubrir el CSO</b>	R0500	40.979,35	38.033,51	0,00	0,00	2.945,84
<b>Total de fondos propios disponibles para cubrir el CMO</b>	R0510	38.033,51	38.033,51	0,00	0,00	
<b>Total de fondos propios admisibles para cubrir el CSO</b>	R0540	40.979,35	38.033,51	0,00	0,00	2.945,84
<b>Total de fondos propios admisibles para cubrir el CMO</b>	R0550	38.033,51	38.033,51	0,00	0,00	
CSO	R0580	26.329,85				
CMO	R0600	6.582,46				
<b>Ratio Fondos propios admisibles sobre CSO</b>	R0620	1,56				
<b>Ratio Fondos propios admisibles sobre CMO</b>	R0640	5,78				

(Datos en miles de Euros)

Modelo S.23.01  
Ejercicio 2019

<b>FONDOS PROPIOS</b>		
<b>Reserva de conciliación</b>		
<b>Reserva de reconciliación</b>		<b>Total</b>
Exceso de los activos respecto a los pasivos	R0700	40.979,35
Acciones propias (incluidas como activos en el balance)	R0710	0,00
Dividendos, distribuciones y costes previsibles	R0720	0,00
Otros elementos de los fondos propios básicos	R0730	12.035,84
Ajuste de elementos de fondos propios restringidos respecto a FDL y CSAC	R0740	0,00
<b>Total reserva de conciliación</b>	R0760	<b>28.943,51</b>
<b>Beneficios esperados incluidos en primas futuras</b>		
<b>Beneficios esperados</b>		<b>Total</b>
		<b>C0060</b>
Beneficios esperados incluidos en primas futuras - Actividades de seguros de vida	R0770	26.062,63
Beneficios esperados incluidos en primas futuras - Actividades de seguros distintos del seguro de vida	R0780 R0790	0,00
<b>Total de beneficios esperados incluidos en primas futuras</b>		<b>0,00</b>

(Datos en miles de Euros)

Modelo S.25.01  
Ejercicio 2019

CAPITAL DE SOLVENCIA OBLIGATORIO				
Para empresas que emplean la fórmula estándar				
		Capital de solvencia obligatorio neto	Capital de solvencia obligatorio bruto	Asignación del ajuste por FDL y CSAC
Riesgo de mercado	R0010	24.309,89	24.309,89	0,00
Riesgo de incumplimiento de contraparte	R0020	766,17	766,17	0,00
Riesgo de suscripción de seguro de vida	R0030	1.874,23	1.874,23	0,00
Riesgo de suscripción de seguros de salud	R0040	405,40	405,40	0,00
Riesgo de suscripción de seguros distintos del seguro de vida	R0050	521,56	521,56	0,00
Diversificación	R0060	-2.568,74	-2.568,74	
Riesgo del inmovilizado intangible	R0070	0,00	0,00	
<b>Capital de solvencia obligatorio básico</b>	R0100	<b>25.308,52</b>	<b>25.308,52</b>	
Cálculo del Capital de Solvencia Obligatorio		Importe		
Ajuste por la agregación del CSO nacional para FDL/CSAC	R0120	0,00		
Riesgo operacional	R0130	1.021,33		
Capacidad de absorción de pérdidas de las PPTT	R0140	0,00		
Capacidad de absorción de pérdidas de los impuestos diferidos	R0150	0,00		
Requerimiento de capital para actividades desarrolladas de acuerdo con el Artículo 4 de la Directiva 2003/41/EC	R0160			
<b>Capital de Solvencia Obligatorio excluida la adición de capital</b>	R0200	<b>26.329,85</b>		
Adición de capital	R0210	0,00		
<b>Capital de Solvencia Obligatorio</b>	R0220	<b>26.329,85</b>		
Otra información sobre el CSO:		Importe		
Requisito de capital para el riesgo del submódulo de renta variable por duraciones	R0400	0,00		
Importe total CSO nacional para la parte restante	R0410	0,00		
Importe total CSO nacional para los FDL	R0420	0,00		
Importe total CSO nacional para las CSAC	R0430	0,00		
Diversificación por la agregación de FDL y CSAC bajo el artículo 304	R0440	0,00		
Método utilizado para calcular el ajuste por la agregación del CSO nacional para FDL y CSAC	R0450	x38		
Beneficios discrecionales futuros netos	R0460	0,00		
<i>(Datos en miles de Euros)</i>				
Enfoque respecto al tipo impositivo				
Enfoque basado en el tipo impositivo medio	R0590		x77	