

Bruxelles, le 25 avril 2016

## Annexe 1 à la circulaire NBB\_2016\_13

### Annexe technique 1

Calcul de la contribution d'une filiale d'assurance et de réassurance au capital de solvabilité requis («CSR») du groupe [orientations 9, 11 et 12]

$$\text{Contrj} = \text{CSRj} \times \text{CSRdiversifié} / \sum_i \text{CSRisolo}$$

Sachant que:

- CSRj est le CSR au niveau de l'entité individuelle de l'entreprise j;
- CSRdiversifié est le CSR calculé conformément à l'article 336, point a), du Règlement 2015/35;
- CSRisolo est le CSR au niveau de l'entité individuelle de l'entreprise participante et de chaque entreprise d'assurance ou de réassurance liée et de toute entreprise d'assurance et de réassurance de pays tiers incluse dans le calcul du CSRdiversifié;
- le ratio correspond à l'ajustement proportionnel découlant de la constatation des effets de la diversification au niveau du groupe.

Pour les entreprises incluses dans les données consolidées avec la consolidation proportionnelle, conformément à l'article 335, paragraphe 1, point c), du Règlement 2015/35, seule la part proportionnelle du CSR au niveau de l'entité individuelle est incluse dans le calcul susmentionné.