

Information trimestrielle juin 2016 - 28 juillet 2016

Groupe CM11
Crédit  Mutuel

GRUPE CM11*

Informations financières spécifiques
(basées sur les recommandations du Financial
Stability Board)

**GRUPE CM11: Groupes adhérents de la Caisse Fédérale de Crédit Mutuel. Chiffres consolidés des Caisses de Crédit Mutuel Centre Est Europe, Sud-Est, ile de France, Savoie-Mont Blanc, Midi-Atlantique, Loire-Atlantique et Centre-Ouest, Centre, Normandie, Dauphiné-Vivarais, Méditerranée et Anjou, de leur Caisse fédérale commune (CF de CM), de la Banque Fédérative du Crédit Mutuel, et de ses principales filiales : ACM, BECM, informatique, CIC, Targobank Allemagne, Cofidis, CIC Iberbanco.*

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/16	Valeur comptable 31/12/15
RMBS	2 527	3 198
CMBS	191	412
CLO	1 820	1 666
Autres ABS	1 718	1 564
RMBS couverts par des CDS		
CLO couverts par des CDS	14	38
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	218	223
Total	6 488	7 101

Sauf mention contraire, les titres ne sont pas couverts par des CDS.

Valeur comptable 30/06/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	267	10	127	32	436
Available for sale	1 685	181	1 487	1 467	4 820
Loans	575		206	219	1 000
Total	2 527	191	1 820	1 718	6 256
France	3		22	406	431
Espagne	79			108	187
Royaume Uni	415		65	153	633
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	590	62	593	1 051	2 296
USA	1 436	129	551		2 116
Autres	4		589		593
Total	2 527	191	1 820	1 718	6 256
US Agencies	1 034				1 034
AAA	666	140	1 729	955	3 490
AA	276		34	483	793
A	81		32	40	153
BBB	40	51	4	240	335
BB	33		2		35
Inférieur ou égal à B	397		2		399
Non noté			17		17
Total	2 527	191	1 820	1 718	6 256

Valeur comptable 31/12/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 078	70	135	52	1 335
Available for sale	1 482	342	1 267	1 337	4 428
Loans	638		264	175	1 077
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840
France	9		22	379	410
Espagne	85			51	136
Royaume Uni	374	19	50	189	632
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	740	60	553	928	2 281
USA	1 983	333	769	17	3 102
Autres	7		272		279
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840
US Agencies	1 514				1 514
AAA	800	359	1 625	998	3 782
AA	266			327	593
A	92		16	161	269
BBB	40	53	4	61	158
BB	31		2		33
Inférieur ou égal à B	455		2	17	474
Non noté			17		17
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840

Valeur comptable 30/06/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	175	51			226
Origination 2006-2008	783	129	128	32	1 072
Origination 2009-2011	117			17	134
Origination 2012-2016	1 452	11	1 692	1 669	4 824
Total	2 527	191	1 820	1 718	6 256

Au 30 juin 2016, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 14 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.

Au 30 juin 2016, il n'y a pas de lignes de liquidité accordées à des programmes RMBS et les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 218 millions d'euros.