

GROUPE CREDIT MUTUEL-CM11*

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

**GROUPE CREDIT MUTUEL-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

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/16	Valeur comptable 31/12/15
RMBS	2 237	3 198
CMBS	63	412
CLO	1 911	1 666
Autres ABS	1 710	1 564
RMBS couverts par des CDS		
CLO couverts par des CDS	6	38
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	218	223
Total	6 145	7 101

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

Exposition au 30 septembre 2016

Valeur comptable 30/09/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	207		114	44	365
Available for sale	1 477	63	1 640	1 281	4 461
Loans	553		157	385	1 095
Total	2 237	63	1 911	1 710	5 921
France	73		22	563	658
Espagne	75			127	202
Royaume Uni	249		65	75	389
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	533	51	553	945	2 082
USA	1 304	12	572		1 888
Autres	3		699		702
Total	2 237	63	1 911	1 710	5 921
US Agencies	900				900
AAA	640	12	1 816	857	3 325
AA	177		48	438	663
A	65		22	22	109
BBB	39	51	4	233	327
BB	32		4		36
Inférieur ou égal à B	384				384
Non noté			17	160	177
Total	2 237	63	1 911	1 710	5 921

Exposition au 31 décembre 2015

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

Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	158	51			209
Origination 2006-2008	675	12	75	32	794
Origination 2009-2011	144			2	146
Origination 2012-2016	1 260		1 836	1 676	4 772
Total	2 237	63	1 911	1 710	5 921

Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2016, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 6 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.

Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 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.