

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 <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/12/16	Valeur comptable 31/12/15
RMBS	2 798	3 198
CMBS	51	412
CLO	2 075	1 666
Autres ABS	1 640	1 564
RMBS couverts par des CDS		
CLO couverts par des CDS	5	38
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	185	223
Total	6 754	7 101

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

Exposition au 31 décembre 2016

Valeur comptable 31/12/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	762		113	47	922
Available for sale	1 501	51	1 814	1 367	4 733
Loans	535		148	226	909
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564
France	130		58	412	600
Espagne	72			116	188
Royaume Uni	295		85	162	542
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	450	51	436	950	1 887
USA	1 850		894		2 744
Autres	1		602		603
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564
US Agencies	1 451				1 451
AAA	686		1 990	972	3 648
AA	157		48	425	630
A	62		22	13	97
BBB	31	51	4	230	316
BB	31				31
Inférieur ou égal à B	380				380
Non noté			11		11
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564

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 31/12/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	150	51			201
Origination 2006-2008	650		45	32	727
Origination 2009-2011	136				136
Origination 2012-2016	1 862		2 030	1 608	5 500
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564

Expositions couvertes par des CDS

Au 31 décembre 2016, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 5 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.

Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 décembre 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 185 millions d'euros.