

**GROUPE CAMCA - 2019**

**Annexe I**

**S.02.01.02**

**Bilan**

**Données en K€**

Actifs		Valeur
		Solvabilité II C0010
Immobilisations incorporelles	<b>R0030</b>	0
Actifs d'impôts différés	<b>R0040</b>	24 595
Excédent du régime de retraite	<b>R0050</b>	0
Immobilisations corporelles détenues pour usage propre	<b>R0060</b>	0
Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés)	<b>R0070</b>	3 182 477
Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre)	<b>R0080</b>	71 285
Détentions dans des entreprises liées, y compris participations	<b>R0090</b>	2 012
Actions	<b>R0100</b>	0
Actions – cotées	<b>R0110</b>	0
Actions – non cotées	<b>R0120</b>	0
Obligations	<b>R0130</b>	2 289 747
Obligations d'État	<b>R0140</b>	1 310 220
Obligations d'entreprise	<b>R0150</b>	979 526
Titres structurés	<b>R0160</b>	0
Titres garantis	<b>R0170</b>	0
Organismes de placement collectif	<b>R0180</b>	819 434
Produits dérivés	<b>R0190</b>	0
Dépôts autres que les équivalents de trésorerie	<b>R0200</b>	0
Autres investissements	<b>R0210</b>	0
Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés	<b>R0220</b>	0
Prêts et prêts hypothécaires	<b>R0230</b>	4
Avances sur police	<b>R0240</b>	0
Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers	<b>R0250</b>	4
Autres prêts et prêts hypothécaires	<b>R0260</b>	0
Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance	<b>R0270</b>	13 464
Non-vie et santé similaire à la non-vie	<b>R0280</b>	13 464
Non-vie hors santé	<b>R0290</b>	15 730
Santé similaire à la non-vie	<b>R0300</b>	-2 266
Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés	<b>R0310</b>	0
Santé similaire à la vie	<b>R0320</b>	0
Vie hors santé, UC et indexés	<b>R0330</b>	0
Vie UC et indexés	<b>R0340</b>	0
Dépôts auprès des cédantes	<b>R0350</b>	0
Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires	<b>R0360</b>	69 867
Créances nées d'opérations de réassurance	<b>R0370</b>	12 998
Autres créances (hors assurance)	<b>R0380</b>	4 072
Actions propres auto-détenues (directement)	<b>R0390</b>	0
Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s)	<b>R0400</b>	0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	<b>R0410</b>	83 645
Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus	<b>R0420</b>	1 895
<b>Total de l'actif</b>	<b>R0500</b>	<b>3 393 017</b>

**GROUPE CAMCA - 2019**

**Annexe I**

**S.02.01.02**

**Bilan**

**Données en K€**

<b>Passifs</b>		<b>Valeur</b>
		<b>Solvabilité II</b>
		<b>C0010</b>
Provisions techniques non-vie	<b>R0510</b>	2 103 276
Provisions techniques non-vie (hors santé)	<b>R0520</b>	2 112 754
Provisions techniques calculées comme un tout	<b>R0530</b>	0
Meilleure estimation	<b>R0540</b>	2 067 567
Marge de risque	<b>R0550</b>	45 187
Provisions techniques santé (similaire à la non-vie)	<b>R0560</b>	-9 478
Provisions techniques calculées comme un tout	<b>R0570</b>	0
Meilleure estimation	<b>R0580</b>	-9 514
Marge de risque	<b>R0590</b>	36
Provisions techniques vie (hors UC et indexés)	<b>R0600</b>	0
Provisions techniques santé (similaire à la vie)	<b>R0610</b>	0
Provisions techniques calculées comme un tout	<b>R0620</b>	0
Meilleure estimation	<b>R0630</b>	0
Marge de risque	<b>R0640</b>	0
Provisions techniques vie (hors santé, UC et indexés)	<b>R0650</b>	0
Provisions techniques calculées comme un tout	<b>R0660</b>	0
Meilleure estimation	<b>R0670</b>	0
Marge de risque	<b>R0680</b>	0
Provisions techniques UC et indexés	<b>R0690</b>	0
Provisions techniques calculées comme un tout	<b>R0700</b>	0
Meilleure estimation	<b>R0710</b>	0
Marge de risque	<b>R0720</b>	0
Passifs éventuels	<b>R0740</b>	21 887
Provisions autres que les provisions techniques	<b>R0750</b>	689
Provisions pour retraite	<b>R0760</b>	0
Dépôts des réassureurs	<b>R0770</b>	24
Passifs d'impôts différés	<b>R0780</b>	247 790
Produits dérivés	<b>R0790</b>	0
Dettes envers des établissements de crédit	<b>R0800</b>	0
Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit	<b>R0810</b>	0
Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires	<b>R0820</b>	49 878
Dettes nées d'opérations de réassurance	<b>R0830</b>	12 710
Autres dettes (hors assurance)	<b>R0840</b>	21 694
Passifs subordonnés	<b>R0850</b>	4 000
Passifs subordonnés non inclus dans les fonds propres de base	<b>R0860</b>	0
Passifs subordonnés inclus dans les fonds propres de base	<b>R0870</b>	4 000
Autres dettes non mentionnées dans les postes ci-dessus	<b>R0880</b>	40
<b>Total du passif</b>	<b>R0900</b>	<b>2 461 988</b>
<b>Excédent d'actif sur passif</b>	<b>R1000</b>	<b>931 029</b>



GROUPE CAMCA - 2019

Annexe III

S.22.01.22

Impact des mesures relatives aux garanties de long terme et des mesures transitoires

Données en K€

	Montant avec mesures relatives aux garanties de long terme et mesures transitoires	Impact de toutes les mesures relatives aux garanties de long terme et de toutes les mesures transitoires (approche par étapes)									
		Sans la mesure transitoire portant sur les provisions techniques	Impact des mesures transitoires sur les provisions techniques	Sans la mesure transitoire portant sur les taux d'intérêt	Impact des mesures transitoires sur les taux d'intérêt	Sans la correction pour volatilité et sans autres mesures transitoires	Impact d'une correction pour volatilité fixée à zéro	Sans l'ajustement égalisateur et sans aucune des autres mesures	Impact d'un ajustement égalisateur fixé à zéro	Impact de toutes les mesures relatives aux garanties de long terme et de toutes les mesures transitoires	
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100
<b>Provisions techniques</b>	<b>R0010</b>	2 103 276	2 103 276		2 103 276		2 105 645	2 369	2 105 645		2 369
<b>Fonds propres de base</b>	<b>R0020</b>	911 262	911 262		911 262		909 090	-2 171	909 090		-2 171
Excédent d'actif sur passif	<b>R0030</b>	931 029	931 029		931 029		928 857	-2 171	928 857		-2 171
Fonds propres restreints en raison du cantonnement et du portefeuille sous ajustement égalisateur	<b>R0040</b>	0	0		0		0	0	0		0
<b>Fonds propres éligibles pour couvrir le SCR</b>	<b>R0050</b>	911 262	911 262		911 262		909 090	-2 171	909 090		-2 171
Niveau 1	<b>R0060</b>	911 262	911 262		911 262		909 090	-2 171	909 090		-2 171
Niveau 2	<b>R0070</b>	0	0		0		0	0	0		0
Niveau 3	<b>R0080</b>	0	0		0		0	0	0		0
<b>Capital de solvabilité requis</b>	<b>R0090</b>	473 238	473 238		473 238		474 649	1 411	474 649		1 411

GROUPE CAMCA - 2019

Annexe IV

S.23.01.04

Fonds propres (Groupe Annuel)

Données en K€

	Total	Niveau 1 – non restreint	Niveau 1 – restreint	Niveau 2	Niveau 3
	C0010	C0020	C0030	C0040	C0050
<b>Fonds propres de base avant déduction pour participations dans d'autres secteurs financiers</b>					
Capital en actions ordinaires (brut des actions propres)	R0010	-	-	-	-
Capital en actions ordinaires appelé non versé non disponible au niveau	R0020	-	-	-	-
Compte de primes d'émission lié au capital en actions ordinaires	R0030	-	-	-	-
Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de	R0040	400	400	-	-
Comptes mutualistes subordonnés	R0050	-	-	-	-
Comptes mutualistes subordonnés non disponibles au niveau du groupe	R0060	-	-	-	-
Fonds excédentaires	R0070	-	-	-	-
Fonds excédentaires non disponibles au niveau du groupe	R0080	-	-	-	-
Actions de préférence	R0090	-	-	-	-
Actions de préférence non disponibles au niveau du groupe	R0100	-	-	-	-
Compte de primes d'émission lié aux actions de préférence	R0110	-	-	-	-
Comptes de primes d'émission liés aux actions de préférence, non	R0120	-	-	-	-
Réserve de réconciliation	R0130	787 778	787 778	-	-
Passifs subordonnés	R0140	4 000	-	4 000	-
Passifs subordonnés non disponibles au niveau du groupe	R0150	-	-	-	-
Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets	R0160	-	-	-	-
Montant égal à la valeur des actifs d'impôts différés nets non disponibles	R0170	-	-	-	-
Autres éléments approuvés par l'autorité de contrôle en tant que fonds	R0180	-	-	-	-
Fonds propres non disponibles relatifs à d'autres éléments de fonds	R0190	-	-	-	-
Intérêts minoritaires (non déclarés dans le cadre d'un autre élément de	R0200	140 914	140 914	-	-
Intérêts minoritaires non disponibles au niveau du groupe	R0210	21 830	21 830	-	-
<b>Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus</b>					
Fonds propres issus des états financiers qui ne devraient pas être inclus	R0220	-	-	-	-
<b>Déductions</b>					
Déductions pour participations dans d'autres entreprises financières, y	R0230	-	-	-	-
dont déduites conformément à l'article 228 de la directive 2009/138/CE	R0240	-	-	-	-
Déductions pour les participations lorsque les informations sont	R0250	-	-	-	-
Déduction pour les participations incluses par déduction et agrégation	R0260	-	-	-	-
Total des éléments de fonds propres non disponibles	R0270	21 830	21 830	-	-
<b>Total déductions</b>	R0280	21 830	21 830	-	-
<b>Total fonds propres de base après déductions</b>	R0290	911 262	907 262	4 000	-
<b>Fonds propres auxiliaires</b>					
Capital en actions ordinaires non libéré et non appelé, callable sur	R0300	-	-	-	-
Fonds initial, cotisations des membres ou élément de fonds propres de	R0310	-	-	-	-
Actions de préférence non libérées et non appelées, callable sur	R0320	-	-	-	-
Engagements juridiquement contraignants de souscrire et de payer des	R0330	-	-	-	-
Lettres de crédit et garanties relevant de l'article 96, paragraphe 2, de la	R0340	-	-	-	-
Lettres de crédit et garanties ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 2,	R0350	-	-	-	-
Rappels de cotisations en vertu de l'article 96, point 3, de la directive	R0360	-	-	-	-
Rappels de cotisations ne relevant pas de l'article 96, paragraphe 3,	R0370	-	-	-	-
Fonds propres auxiliaires non disponibles au niveau du groupe	R0380	-	-	-	-
Autres fonds propres auxiliaires	R0390	-	-	-	-
<b>Total fonds propres auxiliaires</b>	R0400	-	-	-	-
<b>Fonds propres d'autres secteurs financiers</b>					
Établissements de crédit, entreprises d'investissement, établissements	R0410	-	-	-	-
Institution de retraite professionnelle	R0420	-	-	-	-
Entités non réglementées exerçant des activités financières	R0430	-	-	-	-
Total fonds propres d'autres secteurs financiers	R0440	-	-	-	-
<b>Fonds propres en cas de recours à la méthode de déduction et</b>					
Fonds propres agrégés en cas d'utilisation de la déduction et agrégation ou	R0450	-	-	-	-
Fonds propres agrégés en cas d'utilisation de la déduction et agrégation ou	R0460	-	-	-	-
Total des fonds propres disponibles servant à couvrir le capital de	R0520	911 262	907 262	4 000	-
Total des fonds propres disponibles pour couvrir le minimum de capital	R0530	911 262	907 262	4 000	-
Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité	R0560	911 262	907 262	4 000	-
Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de	R0570	911 262	907 262	4 000	-
<b>Capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée</b>	R0590	473 238	-	-	-
<b>Minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée</b>	R0610	212 957	-	-	-
<b>Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis du groupe</b>	R0630	192,56%	-	-	-
<b>Ratio fonds propres éligibles sur minimum de capital de solvabilité</b>	R0650	427,91%	-	-	-
<b>Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de</b>	R0660	911 262	907 262	4 000	-
<b>Capital de solvabilité requis pour les entreprises incluses par déduction</b>	R0670	-	-	-	-
<b>Capital de solvabilité requis du groupe</b>	R0680	473 238	-	-	-
<b>Ratio fonds propres éligibles sur capital de solvabilité requis du groupe</b>	R0690	192,56%	-	-	-

C0060

<b>Réserve de réconciliation</b>		
Excédent d'actif sur passif	R0700	931 029
Actions propres (détenues directement et indirectement)	R0710	-
Dividendes, distributions et charges prévisibles	R0720	1 937
Autres éléments de fonds propres de base	R0730	141 314
Ajustement pour les éléments de fonds propres restreints relatifs aux	R0740	-
Autres fonds propres non disponibles	R0750	-
<b>Réserve de réconciliation</b>	R0760	787 778
<b>Bénéfices attendus</b>		
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités vie	R0770	-
Bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP) – activités non-	R0780	-
<b>Total bénéfices attendus inclus dans les primes futures (EPIFP)</b>	R0790	-

**GROUPE CAMCA - 2019**

**Annexe V**

**S.25.01.01**

**Capital de solvabilité requis – pour les entreprises qui utilisent la formule standard**

**Données en K€**

		Capital de solvabilité requis net	Capital de solvabilité requis brut	Attribution des ajustements dus aux FC et aux PAE
		C0030	C0040	C0050
Risque de marché	<b>R0010</b>	202 978	202 978	0
Risque de défaut de la contrepartie	<b>R0020</b>	18 242	18 242	0
Risque de souscription en vie	<b>R0030</b>	0	0	0
Risque de souscription en santé	<b>R0040</b>	10 430	10 430	0
Risque de souscription en non-vie	<b>R0050</b>	503 081	503 081	0
Diversification	<b>R0060</b>	-136 424	-136 424	
Risque lié aux immobilisations incorporelles	<b>R0070</b>	0	0	
<b>Capital de solvabilité requis de base</b>	<b>R0100</b>	598 307	598 307	

Calcul du capital de solvabilité requis		C0100
Risque opérationnel	<b>R0130</b>	61 742
Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques	<b>R0140</b>	0
Capacité d'absorption de pertes des impôts différés	<b>R0150</b>	-186 811
Capital requis pour les activités exercées conformément à	<b>R0160</b>	0
<b>Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire</b>	<b>R0200</b>	473 238
Exigences de capital supplémentaire déjà définies	<b>R0210</b>	0
<b>Capital de solvabilité requis</b>	<b>R0220</b>	473 238
<b>Autres informations sur le SCR</b>		
Capital requis pour le sous-module risque sur actions fondé sur la durée	<b>R0400</b>	0
Total du capital de solvabilité requis notionnel pour la part restante	<b>R0410</b>	0
Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les fonds cantonnés	<b>R0420</b>	0
Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les portefeuilles sous ajustement égalisateur	<b>R0430</b>	0
Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304	<b>R0440</b>	0

**GROUPE CAMCA - 2019**

**Annexe VI**

**S.32.01.04**

**Entreprises dans le périmètre du groupe**

**Données en K€**

<b>Pays</b>	<b>Code d'identification de l'entreprise</b>	<b>Type de code d'identification de l'entreprise</b>	<b>Nom juridique de l'entreprise</b>	<b>Type d'entreprise</b>	<b>Forme juridique</b>	<b>Catégorie (mutuelle/non mutuelle)</b>	<b>Autorité de contrôle</b>
France	LEI/969500K3S8TYLLGGG154		CAMCA Mutuelle	2- Entreprise d'assurance non-vie	Société d'assurance mutuelle	1- Mutuelle	Autorité de contrôle prudentiel et de résolution
Luxembourg	LEI/222100I7Z4ZOEKHLBI64		CAMCA Assurance	2- Entreprise d'assurance non-vie	Société anonyme	2- Non mutuelle	Commissariat aux assurances
France	LEI/969500SFPC744FQP2O39		CAMCA Courtage	99-Autre	Société anonyme	2- Non mutuelle	
Luxembourg	LEI/222100OK3R0C26F84J86		CAMCA Réassurance	2- Entreprise d'assurance non-vie	Société anonyme	2- Non mutuelle	Commissariat aux assurances
Luxembourg	LEI/54930058T7SM276XD825		CAMCA Lux Finance	99-Autre	Société anonyme	2- Non mutuelle	
France	LEI/969500YFLKDCON4NTF85		La Boétie 65	99-Autre	Société de droit commun	2- Non mutuelle	
France	LEI/969500KNKI2RUK818E86		Hausmann 122	99-Autre	Société de droit commun	2- Non mutuelle	
Luxembourg	SC/E-437		Liberté 32	99-Autre	Société de droit commun	2- Non mutuelle	

**GROUPE CAMCA - 2019****Annexe VI****S.32.01.04****Entreprises dans le périmètre du groupe****Données en K€**

<b>Critères de classement (dans la monnaie de déclaration du groupe)</b>								
<b>Nom juridique de l'entreprise</b>	<b>Total du bilan (entreprises d'assurance et de réassurance)</b>	<b>Total du bilan (autres entreprises réglementées)</b>	<b>Total du bilan (entreprises non réglementées)</b>	<b>Primes émises, nettes de réassurance, des entreprises d'assurance ou de réassurance, selon IFRS ou référentiel comptable local</b>	<b>Chiffre d'affaires, défini comme le produit brut des activités ordinaires selon les IFRS ou le référentiel comptable local, pour les autres types d'entreprises et de sociétés holding d'assurance</b>	<b>Résultats de souscription</b>	<b>Résultats des investissements</b>	<b>Résultats totaux</b>
CAMCA Mutuelle	939 887	-	-	226 894	-	9 310	5 938	7 301
CAMCA Assurance	2 333 077	-	-	284 772	-	15 629	3 169	14 240
CAMCA Courtage	-	-	45 586	-	17 133	-	-	5 148
CAMCA Réassurance	886 299	-	-	65 671	-	650	31	0
CAMCA Lux Finance	-	-	593	-	390	-	-	4
La Boétie 65	-	-	12 450	-	1 125	-	-	-
Hausmann 122	-	-	550	-	32	-	-	-
Liberté 32	-	-	2 425	-	213	-	-	-



**GROUPE CAMCA - 2019****Annexe VI****S.32.01.04****Entreprises dans le périmètre du groupe****Données en K€**

Nom juridique de l'entreprise	Référentiel comptable	Critères d'influence					Part proportionnelle utilisée pour le calcul de la solvabilité du groupe
		% de part de capital	% utilisé pour l'établissement des comptes consolidés	% des droits de vote	Autres critères	Degré d'influence	
CAMCA Mutuelle	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	100,00%
CAMCA Assurance	2- Référentiel comptable local	66,00%	100,00%	66,00%		Dominante	64,35%
CAMCA Courtage	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	
CAMCA Réassurance	2- Référentiel comptable local	95,00%	100,00%	95,00%		Dominante	95,00%
CAMCA Lux Finance	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	
La Boétie 65	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	
Hausmann 122	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	
Liberté 32	2- Référentiel comptable local	100,00%	100,00%	100,00%		Dominante	

**GROUPE CAMCA - 2019****Annexe VI****S.32.01.04****Entreprises dans le périmètre du groupe****Données en K€**

<b>Nom juridique de l'entreprise</b>	<b>Inclusion dans le contrôle de groupe</b>		<b>Calcul de solvabilité du groupe</b>
	<b>Oui/Non</b>	<b>Date de la décision si l'article 214 s'applique</b>	<b>Méthode utilisée et, en cas d'utilisation de la première méthode, traitement de l'entreprise</b>
CAMCA Mutuelle	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
CAMCA Assurance	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
CAMCA Courtage	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
CAMCA Réassurance	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
CAMCA Lux Finance	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
La Boétie 65	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
Hausmann 122	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale
Liberté 32	1- Incluse dans le contrôle du groupe		1- Première méthode ; Consolidation Intégrale