

GROUPE CAMCA - 2020

Annexe I

S.02.01.02

Bilan

Données en K€

| | | Valeur Solvabilité II |
|---|--------------|----------------------------------|
| Actifs | | C0010 |
| Immobilisations incorporelles | R0030 | 0 |
| Actifs d'impôts différés | R0040 | 34 234 |
| Excédent du régime de retraite | R0050 | 0 |
| Immobilisations corporelles détenues pour usage propre | R0060 | 0 |
| Investissements (autres qu'actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés) | R0070 | 3 476 571 |
| Biens immobiliers (autres que détenus pour usage propre) | R0080 | 71 621 |
| Détentions dans des entreprises liées, y compris participations | R0090 | 2 006 |
| Actions | R0100 | 0 |
| Actions – cotées | R0110 | 0 |
| Actions – non cotées | R0120 | 0 |
| Obligations | R0130 | 2 479 915 |
| Obligations d'État | R0140 | 1 194 599 |
| Obligations d'entreprise | R0150 | 1 285 316 |
| Titres structurés | R0160 | 0 |
| Titres garantis | R0170 | 0 |
| Organismes de placement collectif | R0180 | 923 029 |
| Produits dérivés | R0190 | 0 |
| Dépôts autres que les équivalents de trésorerie | R0200 | 0 |
| Autres investissements | R0210 | 0 |
| Actifs en représentation de contrats en unités de compte et indexés | R0220 | 0 |
| Prêts et prêts hypothécaires | R0230 | 1 |
| Avances sur police | R0240 | 0 |
| Prêts et prêts hypothécaires aux particuliers | R0250 | 1 |
| Autres prêts et prêts hypothécaires | R0260 | 0 |
| Montants recouvrables au titre des contrats de réassurance | R0270 | 29 716 |
| Non-vie et santé similaire à la non-vie | R0280 | 29 716 |
| Non-vie hors santé | R0290 | 29 845 |
| Santé similaire à la non-vie | R0300 | -129 |
| Vie et santé similaire à la vie, hors santé, UC et indexés | R0310 | 0 |
| Santé similaire à la vie | R0320 | 0 |
| Vie hors santé, UC et indexés | R0330 | 0 |
| Vie UC et indexés | R0340 | 0 |
| Dépôts auprès des cédantes | R0350 | 0 |
| Créances nées d'opérations d'assurance et montants à recevoir d'intermédiaires | R0360 | 69 246 |
| Créances nées d'opérations de réassurance | R0370 | 14 584 |
| Autres créances (hors assurance) | R0380 | 3 217 |
| Actions propres auto-détenues (directement) | R0390 | 0 |
| Éléments de fonds propres ou fonds initial appelé(s), mais non encore payé(s) | R0400 | 0 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | R0410 | 82 965 |
| Autres actifs non mentionnés dans les postes ci-dessus | R0420 | 2 087 |
| Total de l'actif | R0500 | 3 712 622 |

GROUPE CAMCA - 2020

Annexe I

S.02.01.02

Bilan

Données en K€

| Passifs | | Valeur |
|--|--------------|-----------------------|
| | | Solvabilité II |
| | | C0010 |
| Provisions techniques non-vie | R0510 | 2 414 269 |
| Provisions techniques non-vie (hors santé) | R0520 | 2 423 982 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0530 | 0 |
| Meilleure estimation | R0540 | 2 372 119 |
| Marge de risque | R0550 | 51 863 |
| Provisions techniques santé (similaire à la non-vie) | R0560 | -9 713 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0570 | 0 |
| Meilleure estimation | R0580 | -9 740 |
| Marge de risque | R0590 | 27 |
| Provisions techniques vie (hors UC et indexés) | R0600 | 0 |
| Provisions techniques santé (similaire à la vie) | R0610 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0620 | 0 |
| Meilleure estimation | R0630 | 0 |
| Marge de risque | R0640 | 0 |
| Provisions techniques vie (hors santé, UC et indexés) | R0650 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0660 | 0 |
| Meilleure estimation | R0670 | 0 |
| Marge de risque | R0680 | 0 |
| Provisions techniques UC et indexés | R0690 | 0 |
| Provisions techniques calculées comme un tout | R0700 | 0 |
| Meilleure estimation | R0710 | 0 |
| Marge de risque | R0720 | 0 |
| Passifs éventuels | R0740 | 24 207 |
| Provisions autres que les provisions techniques | R0750 | 737 |
| Provisions pour retraite | R0760 | 0 |
| Dépôts des réassureurs | R0770 | 24 |
| Passifs d'impôts différés | R0780 | 225 573 |
| Produits dérivés | R0790 | 0 |
| Dettes envers des établissements de crédit | R0800 | 0 |
| Dettes financières autres que celles envers les établissements de crédit | R0810 | 0 |
| Dettes nées d'opérations d'assurance et montants dus aux intermédiaires | R0820 | 51 519 |
| Dettes nées d'opérations de réassurance | R0830 | 11 797 |
| Autres dettes (hors assurance) | R0840 | 38 653 |
| Passifs subordonnés | R0850 | 4 000 |
| Passifs subordonnés non inclus dans les fonds propres de base | R0860 | 0 |
| Passifs subordonnés inclus dans les fonds propres de base | R0870 | 4 000 |
| Autres dettes non mentionnées dans les postes ci-dessus | R0880 | 254 |
| Total du passif | R0900 | 2 771 033 |
| Excédent d'actif sur passif | R1000 | 941 589 |

GROUPE CAMCA - 2020

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 |
| Provisions techniques | R0010 | 2 414 269 | 2 414 269 | | 2 414 269 | | 2 417 654 | 3 385 | 2 417 654 | | 3 385 |
| Fonds propres de base | R0020 | 912 318 | 912 318 | | 912 318 | | 909 813 | -2 504 | 909 813 | | -2 504 |
| Excédent d'actif sur passif | R0030 | 941 589 | 941 589 | | 941 589 | | 939 084 | -2 504 | 939 084 | | -2 504 |
| Fonds propres restreints en raison du cantonnement et du portefeuille sous ajustement égalisateur | R0040 | 0 | 0 | | 0 | | 0 | 0 | 0 | | 0 |
| Fonds propres éligibles pour couvrir le SCR | R0050 | 912 318 | 912 318 | | 912 318 | | 909 813 | -2 504 | 909 813 | | -2 504 |
| Niveau 1 | R0060 | 912 318 | 912 318 | | 912 318 | | 909 813 | -2 504 | 909 813 | | -2 504 |
| Niveau 2 | R0070 | 0 | 0 | | 0 | | 0 | 0 | 0 | | 0 |
| Niveau 3 | R0080 | 0 | 0 | | 0 | | 0 | 0 | 0 | | 0 |
| Capital de solvabilité requis | R0090 | 424 095 | 424 095 | | 424 095 | | 424 194 | 98 | 424 194 | | 98 |

GROUPE CAMCA - 2020

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 | R0010 | 230 583 | 230 583 | 0 |
| Risque de défaut de la contrepartie | R0020 | 27 069 | 27 069 | 0 |
| Risque de souscription en vie | R0030 | 0 | 0 | 0 |
| Risque de souscription en santé | R0040 | 12 326 | 12 326 | 0 |
| Risque de souscription en non-vie | R0050 | 383 254 | 769 178 | 0 |
| Diversification | R0060 | -143 128 | -167 435 | |
| Risque lié aux immobilisations incorporelles | R0070 | 0 | 0 | |
| Capital de solvabilité requis de base | R0100 | 510 104 | 871 720 | |

| Calcul du capital de solvabilité requis | | C0100 |
|---|--------------|----------------|
| Risque opérationnel | R0130 | 70 871 |
| Capacité d'absorption des pertes des provisions techniques | R0140 | -361 617 |
| Capacité d'absorption de pertes des impôts différés | R0150 | -156 880 |
| Capital requis pour les activités exercées conformément à | R0160 | 0 |
| Capital de solvabilité requis à l'exclusion des exigences de capital supplémentaire | R0200 | 424 095 |
| Exigences de capital supplémentaire déjà définies | R0210 | 0 |
| Capital de solvabilité requis | R0220 | 424 095 |
| Autres informations sur le SCR | | |
| Capital requis pour le sous-module risque sur actions fondé sur la durée | R0400 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour la part restante | R0410 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les fonds cantonnés | R0420 | 0 |
| Total du capital de solvabilité requis notionnel pour les portefeuilles sous ajustement égalisateur | R0430 | 0 |
| Effets de diversification dus à l'agrégation des nSCR des FC selon l'article 304 | R0440 | 0 |

GROUPE CAMCA - 2020**Annexe VI****S.32.01.04****Entreprises dans le périmètre du groupe****Données en K€**

| Pays | Code d'identification de l'entreprise | Type de code d'identification de l'entreprise | Nom juridique de l'entreprise | Type d'entreprise | Forme juridique | Catégorie (mutuelle/non mutuelle) | Autorité de contrôle |
|-------------|--|--|--------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------|--|--|
| 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 - 2020

Annexe VI

S.32.01.04

Entreprises dans le périmètre du groupe

Données en K€

| Critères de classement (dans la monnaie de déclaration du groupe) | | | | | | | | |
|---|--|--|---|--|--|---------------------------|-------------------------------|------------------|
| Nom juridique de l'entreprise | Total du bilan (entreprises d'assurance et de réassurance) | Total du bilan (autres entreprises réglementées) | Total du bilan (entreprises non réglementées) | Primes émises, nettes de réassurance, des entreprises d'assurance ou de réassurance, selon IFRS ou référentiel comptable local | 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 | Résultats de souscription | Résultats des investissements | Résultats totaux |
| CAMCA Mutuelle | 864 251 | - | - | 241 608 | - | 13 009 | 5 938 | 12 437 |
| CAMCA Assurance | 2 786 792 | - | - | 447 434 | - | 88 608 | 4 263 | 68 698 |
| CAMCA Courtage | - | - | 40 618 | - | 17 659 | - | - | 4 799 |
| CAMCA Réassurance | 965 625 | - | - | 85 563 | - | 752 | - | - |
| CAMCA Lux Finance | - | - | 516 | - | 333 | - | - | 86 |
| La Boétie 65 | - | - | 10 069 | - | 1 204 | - | - | - |
| Hausmann 122 | - | - | 508 | - | 59 | - | - | - |
| Liberté 32 | - | - | 2 447 | - | 202 | - | - | - |

GROUPE CAMCA - 2020**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 - 2020**Annexe VI****S.32.01.04****Entreprises dans le périmètre du groupe****Données en K€**

| Nom juridique de l'entreprise | Inclusion dans le contrôle de groupe | | Calcul de solvabilité du groupe |
|-------------------------------|---------------------------------------|---|--|
| | Oui/Non | Date de la décision si l'article 214 s'applique | Méthode utilisée et, en cas d'utilisation de la première méthode, traitement de l'entreprise |
| 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 |