

Information semestrielle juin 2013 - 31 juillet 2013



GROUPE CM11-CIC

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



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/13	Valeur comptable 31/12/12
RMBS	2 207	2 391
CMBS	539	333
CLO	1 098	943
Autres ABS	789	731
CLO couverts par des CDS	711	833
Autres ABS couverts par des CDS	23	25
Lignes de liquidité des programmes ABCP	273	351
Total	5 640	5 607

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



Exposition au 30 juin 2013

Valeur comptable 30/06/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	829	476	267	489	2 061
Available for sale	411	63	109	150	733
Loans	967		722	150	1 839
Total	2 207	539	1 098	789	4 633
France		2		442	444
Espagne	107			42	149
Royaume Uni	258			100	358
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	805	88	694	180	1 767
USA	959	449	404	25	1 837
Autres	78				78
Total	2 207	539	1 098	789	4 633
US Agencies	284				284
AAA	605	453	754	502	2 314
AA	276		280	68	624
A	185	21	39	126	371
BBB	76	65	7	34	182
BB	92		15	13	120
Inférieur ou égal à B	689			46	735
Non noté			3		3
Total	2 207	539	1 098	789	4 633



Exposition au 31 décembre 2012

Valeur comptable 31/12/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	921	269	15	505	1 710
Available for sale	478	64	29	75	646
Loans	992		899	151	2 042
Total	2 391	333	943	731	4 398
France	1	2		519	522
Espagne	105			68	173
Royaume Uni	244			47	291
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	706	64	664	72	1 506
USA	1 232	267	279	25	1 803
Autres	103				103
Total	2 391	333	943	731	4 398
US Agencies	447				447
AAA	546	259	383	462	1 650
AA	239		488	53	780
A	188	10	47	150	395
BBB	66	64	12	19	161
BB	101		13		114
Inférieur ou égal à B	804			47	851
Non noté					
Total	2 391	333	943	731	4 398



Expositions par origination

Valeur comptable 30/06/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	361	286		19	666
Origination 2006	370	111	162	32	675
Origination 2007	725	117	419	51	1 312
Origination depuis 2008	751	25	517	687	1 980
Total	2 207	539	1 098	789	4 633



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 juin 2013, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 711 millions d'euros.

Il est de 23 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 juin 2013, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 273 millions d'euros.