

Information trimestrielle septembre 2013 - 14 novembre 2013



## **GROUPE CM11-CIC**

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

Les chiffres figurants dans cette présentation ne sont pas audités.



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/13	Valeur comptable 31/12/12
RMBS	2 115	2 391
CMBS	526	333
CLO	1 331	943
Autres ABS	849	731
CLO couverts par des CDS	542	833
Autres ABS couverts par des CDS	22	25
Lignes de liquidité des programmes ABCP	303	351
<b>Total</b>	<b>5 688</b>	<b>5 607</b>

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



## Exposition au 30 septembre 2013

Valeur comptable 30/09/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	815	466	330	454	2 065
Available for sale	395	60	106	246	807
Loans	905		895	149	1 949
<b>Total</b>	<b>2 115</b>	<b>526</b>	<b>1 331</b>	<b>849</b>	<b>4 821</b>
France		2		413	415
Espagne	106			31	137
Royaume Uni	288			90	378
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	783	85	880	235	1 983
USA	879	439	451	24	1 793
Autres	59			56	115
<b>Total</b>	<b>2 115</b>	<b>526</b>	<b>1 331</b>	<b>849</b>	<b>4 821</b>
US Agencies	262				262
AAA	638	439	816	546	2 439
AA	219		433	89	741
A	198	20	47	122	387
BBB	83	67	12	33	195
BB	83		17	13	113
Inférieur ou égal à B	632			46	678
Non noté			6		6
<b>Total</b>	<b>2 115</b>	<b>526</b>	<b>1 331</b>	<b>849</b>	<b>4 821</b>



## 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
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>
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
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>
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					
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	340	354	28	71	793
Origination 2006	330	71	167	27	595
Origination 2007	689	81	407	50	1 227
Origination depuis 2008	756	20	729	701	2 206
<b>Total</b>	<b>2 115</b>	<b>526</b>	<b>1 331</b>	<b>849</b>	<b>4 821</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2013, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 542 millions d'euros.

Il est de 22 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2013, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 303 millions d'euros.