

Information trimestrielle juin 2011 – 28 juillet 2011



## **GROUPE CM10-CIC**

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



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/11	Valeur comptable 31/12/10
RMBS	4 963	5 579
CMBS	459	458
CLO	1 501	1 887
Autres ABS	1 001	849
CLO couverts par des CDS	721	833
Autres ABS couverts par des CDS	29	49
Lignes de liquidité des programmes ABCP	362	334
<b>Total</b>	<b>9 036</b>	<b>9 989</b>

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



## Exposition au 30 juin 2011

Valeur comptable 30/06/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 870	422		366	2 658
Available for sale	1 462	32	29	428	1 951
Loans	1 631	5	1 472	207	3 315
<b>Total</b>	<b>4 963</b>	<b>459</b>	<b>1 501</b>	<b>1 001</b>	<b>7 924</b>
France	14	2		404	420
Espagne	325		21	262	608
Royaume Uni	1 012	31		48	1 091
Europe hors France	1 746	5	694	204	2 649
USA	1 684	389	786	22	2 881
Autres	182	32		61	275
<b>Total</b>	<b>4 963</b>	<b>459</b>	<b>1 501</b>	<b>1 001</b>	<b>7 924</b>
US Agencies	603				603
AAA	2 660	365	724	639	4 388
AA	497	41	551	125	1 214
A	219	43	187	39	488
BBB	88	8	27	148	271
BB	75	2	12	25	114
Inférieur ou égal à B	821			25	846
Non noté					
<b>Total</b>	<b>4 963</b>	<b>459</b>	<b>1 501</b>	<b>1 001</b>	<b>7 924</b>

RMBS



## Expositions au 31 décembre 2010

Valeur comptable 31/12/10	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 819	306	23	343	2 491
Available for sale	1 835	147	29	287	2 298
Loans	1 925	5	1 835	219	3 984
<b>Total</b>	<b>5 579</b>	<b>458</b>	<b>1 887</b>	<b>849</b>	<b>8 773</b>
France	14	1		407	422
Europe hors France	2 803	84	889	398	4 174
USA	2 366	291	998		3 655
Autres	396	82		44	522
<b>Total</b>	<b>5 579</b>	<b>458</b>	<b>1 887</b>	<b>849</b>	<b>8 773</b>
US Agencies	1 075				1 075
AAA	2 984	346	1 070	601	5 001
AA	322	92	600	78	1 092
A	69	20	179	7	275
BBB	71		26	150	247
BB	43		12	13	68
Inférieur ou égal à B	1 015				1 015
Non noté	0				
<b>Total</b>	<b>5 579</b>	<b>458</b>	<b>1 887</b>	<b>849</b>	<b>8 773</b>

RMBS



## Expositions par origination

Valeur comptable 30/06/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	967	74	87	268	1 396
Origination 2006	1 728	149	573	288	2 738
Origination 2007	1 083	173	508	103	1 867
Origination depuis 2008	1 185	63	333	342	1 923
<b>Total</b>	<b>4 963</b>	<b>459</b>	<b>1 501</b>	<b>1 001</b>	<b>7 924</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 juin 2011, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 721 millions d'euros.

Il est de 29 millions d'euros pour les autres ABS couverts par des CDS.



## Opérations avec des véhicules ad hoc

Au 30 juin 2011, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 362 millions d'euros.



## LBO : détail par zone géographique des structures de financements dédiés

<b>LBO</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/11	Valeur comptable 31/12/10
<b>Détail par zone géographique des structures de financements dédiés</b>		
France	1 647	1 671
Europe hors France	308	408
USA	87	127
Autres	61	70
<b>Total</b>	<b>2 103</b>	<b>2 276</b>
<b>Détail par secteur des structures de financements dédiés (en %)</b>		
Transport industriel	29	28
Biens et services industriels	14	16
Voyages et loisirs	11	9
Construction	7	9
Santé	7	10
Distribution	6	4
Télécommunications	5	6
Autres (<5%)	21	18
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>





## LBO : détail par secteur des structures de financements dédiés (en %)

