

Information trimestrielle septembre 2012 – 14 novembre 2012



## **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 30/09/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	2 715	3 985
CMBS	345	366
CLO	951	1 542
Autres ABS	629	897
CLO couverts par des CDS	856	721
Autres ABS couverts par des CDS	26	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	337	351
<b>Total</b>	<b>5 859</b>	<b>7 890</b>

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



## Exposition au 30 septembre 2012

Valeur comptable 30/09/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 035	276		405	1 716
Available for sale	566	69	29	83	747
Loans	1 114		922	141	2 177
<b>Total</b>	<b>2 715</b>	<b>345</b>	<b>951</b>	<b>629</b>	<b>4 640</b>
France	3	2		421	426
Espagne	110			84	194
Royaume Uni	344	19		51	414
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	788	64	681	48	1 581
USA	1 360	255	270	25	1 910
Autres	110	5			115
<b>Total</b>	<b>2 715</b>	<b>345</b>	<b>951</b>	<b>629</b>	<b>4 640</b>
US Agencies	517				517
AAA	615	247	373	350	1 585
AA	277	19	489	77	862
A	269	13	63	137	482
BBB	61	64	12	15	152
BB	143		14	21	178
Inférieur ou égal à B	833	2		29	864
Non noté					
<b>Total</b>	<b>2 715</b>	<b>345</b>	<b>951</b>	<b>629</b>	<b>4 640</b>



## Exposition au 31 décembre 2011

Valeur comptable 31/12/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 173	353	25	366	1 917
Available for sale	967	13	192	227	1 399
Loans	1 845		1 325	304	3 474
<b>Total</b>	<b>3 985</b>	<b>366</b>	<b>1 542</b>	<b>897</b>	<b>6 790</b>
France	14	2		353	369
Espagne	305		20	206	531
Royaume Uni	413	31		52	496
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	1 306		694	144	2 144
USA	1 795	320	828	121	3 064
Autres	152	13		21	186
<b>Total</b>	<b>3 985</b>	<b>366</b>	<b>1 542</b>	<b>897</b>	<b>6 790</b>
US Agencies	521				521
AAA	1 560	303	716	421	3 000
AA	187	30	737	107	1 061
A	242	23	51	97	413
BBB	145	2	26	121	294
BB	119		12	20	151
Inférieur ou égal à B	1 211	8		131	1 350
Non noté					
<b>Total</b>	<b>3 985</b>	<b>366</b>	<b>1 542</b>	<b>897</b>	<b>6 790</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	478	101		35	614
Origination 2006	613	84	197	51	945
Origination 2007	808	155	423	69	1 455
Origination depuis 2008	816	5	331	474	1 626
<b>Total</b>	<b>2 715</b>	<b>345</b>	<b>951</b>	<b>629</b>	<b>4 640</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 856 millions d'euros.

Il est de 26 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 337 millions d'euros.