

Résultat 2012 – 28 février 2013



GROUPE CM11-CIC

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



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/12/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	2 391	3 985
CMBS	333	366
CLO	943	1 542
Autres ABS	731	897
CLO couverts par des CDS	833	721
Autres ABS couverts par des CDS	25	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	351	351
Total	5 607	7 890

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



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



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
Total	3 985	366	1 542	897	6 790
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
Total	3 985	366	1 542	897	6 790
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					
Total	3 985	366	1 542	897	6 790



Expositions par origination

Valeur comptable 31/12/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	400	98		28	526
Origination 2006	508	60	180	45	793
Origination 2007	746	175	418	60	1 399
Origination depuis 2008	737		345	598	1 680
Total	2 391	333	943	731	4 398



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 décembre 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 833 millions d'euros.

Il est de 25 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 décembre 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 351 millions d'euros.