

Information trimestrielle mars 2014 - 14 mai 2014



## **GROUPE CM11-CIC**

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



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/14	Valeur comptable 31/12/13
RMBS	1 928	1 919
CMBS	584	558
CLO	1 432	1 462
Autres ABS	818	733
RMBS couverts par des CDS	75	
CLO couverts par des CDS	357	476
Autres ABS couverts par des CDS	21	22
Lignes de liquidité des programmes ABCP	303	304
<b>Total</b>	<b>5 518</b>	<b>5 474</b>

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



## Exposition au 31 mars 2014

Valeur comptable 31/03/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	635	525	123	281	1 564
Available for sale	543	59	534	392	1 528
Loans	750		775	145	1 670
<b>Total</b>	<b>1 928</b>	<b>584</b>	<b>1 432</b>	<b>818</b>	<b>4 762</b>
France		2		352	354
Espagne	100			43	143
Royaume Uni	198			63	261
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	860	64	993	346	2 263
USA	724	518	298	14	1 554
Autres	46		141		187
<b>Total</b>	<b>1 928</b>	<b>584</b>	<b>1 432</b>	<b>818</b>	<b>4 762</b>
US Agencies	280				280
AAA	636	499	940	544	2 619
AA	145		430	54	629
A	246	19	33	155	453
BBB	91	66	17	40	214
BB	55		4		59
Inférieur ou égal à B	475			25	500
Non noté			8		8
<b>Total</b>	<b>1 928</b>	<b>584</b>	<b>1 432</b>	<b>818</b>	<b>4 762</b>



## Exposition au 31 décembre 2013

Valeur comptable 31/12/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	700	498	133	294	1 625
Available for sale	450	60	520	295	1 325
Loans	769		809	144	1 722
<b>Total</b>	<b>1 919</b>	<b>558</b>	<b>1 462</b>	<b>733</b>	<b>4 672</b>
France		2		376	378
Espagne	106			22	128
Royaume Uni	259			55	314
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	806	75	1 008	266	2 155
USA	696	481	123	14	1 314
Autres	52		331		383
<b>Total</b>	<b>1 919</b>	<b>558</b>	<b>1 462</b>	<b>733</b>	<b>4 672</b>
US Agencies	243				243
AAA	618	472	971	492	2 553
AA	209		413	65	687
A	203	19	41	124	387
BBB	89	67	12	27	195
BB	72		17		89
Inférieur ou égal à B	485			25	510
Non noté			8		8
<b>Total</b>	<b>1 919</b>	<b>558</b>	<b>1 462</b>	<b>733</b>	<b>4 672</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	298	405	15	12	730
Origination 2006	283	114	204	18	619
Origination 2007	568	65	400	53	1 086
Origination depuis 2008	779		813	735	2 327
<b>Total</b>	<b>1 928</b>	<b>584</b>	<b>1 432</b>	<b>818</b>	<b>4 762</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2014, la valeur comptable des RMBS couverts par des CDS s'élève à 75 millions d'euros. Celle des CLO couverts par des CDS s'élève à 357 millions d'euros. Il est de 21 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2014, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 303 millions d'euros.