

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

TITRISATION <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
Total	5 688	5 607

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
Total	2 115	526	1 331	849	4 821
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
Total	2 115	526	1 331	849	4 821
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
Total	2 115	526	1 331	849	4 821



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



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
Total	2 115	526	1 331	849	4 821



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.