

Information semestrielle juin 2012 – 26 juillet 2012



## **GROUPE CM11-CIC**

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



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	2 855	3 985
CMBS	369	366
CLO	1 106	1 542
Autres ABS	616	897
CLO couverts par des CDS	701	721
Autres ABS couverts par des CDS	26	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	321	351
<b>Total</b>	<b>5 994</b>	<b>7 890</b>

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



## Exposition au 30 juin 2012

Valeur comptable 30/06/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	958	298		387	1 643
Available for sale	668	71	185	88	1 012
Loans	1 229		921	141	2 291
<b>Total</b>	<b>2 855</b>	<b>369</b>	<b>1 106</b>	<b>616</b>	<b>4 946</b>
France	3	2		366	371
Espagne	112		5	102	219
Royaume Uni	436	17		51	504
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	793	65	686	71	1 615
USA	1 395	279	415	26	2 115
Autres	116	6			122
<b>Total</b>	<b>2 855</b>	<b>369</b>	<b>1 106</b>	<b>616</b>	<b>4 946</b>
US Agencies	491				491
AAA	614	269	295	318	1 496
AA	513	17	717	145	1 392
A	125	79	62	87	353
BBB	72		14	15	101
BB	156		18	21	195
Inférieur ou égal à B	884	4		30	918
Non noté					
<b>Total</b>	<b>2 855</b>	<b>369</b>	<b>1 106</b>	<b>616</b>	<b>4 946</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 30/06/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	560	129	2	43	734
Origination 2006	656	94	359	59	1 168
Origination 2007	931	140	414	76	1 561
Origination depuis 2008	708	6	331	438	1 483
<b>Total</b>	<b>2 855</b>	<b>369</b>	<b>1 106</b>	<b>616</b>	<b>4 946</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 juin 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 701 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 juin 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 321 millions d'euros.