

Information semestrielle juin 2014 - 31 juillet 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 30/06/14	Valeur comptable 31/12/13
RMBS	1 937	1 919
CMBS	567	558
CLO	1 394	1 462
Autres ABS	896	733
RMBS couverts par des CDS	72	
CLO couverts par des CDS	262	476
Autres ABS couverts par des CDS		22
Lignes de liquidité des programmes ABCP	303	304
<b>Total</b>	<b>5 431</b>	<b>5 474</b>

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



## Exposition au 30 juin 2014

Valeur comptable 30/06/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	676	507	149	262	1 594
Available for sale	522	60	573	491	1 646
Loans	739		672	143	1 554
<b>Total</b>	<b>1 937</b>	<b>567</b>	<b>1 394</b>	<b>896</b>	<b>4 794</b>
France	19	3		342	364
Espagne	89		8	31	128
Royaume Uni	264			111	375
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	810	64	912	401	2 187
USA	716	500	141	11	1 368
Autres	39		333		372
<b>Total</b>	<b>1 937</b>	<b>567</b>	<b>1 394</b>	<b>896</b>	<b>4 794</b>
US Agencies	269				269
AAA	719	481	936	620	2 756
AA	146		397	80	623
A	217	19	35	110	381
BBB	87	67	14	64	232
BB	28		4		32
Inférieur ou égal à B	471			22	493
Non noté			8		8
<b>Total</b>	<b>1 937</b>	<b>567</b>	<b>1 394</b>	<b>896</b>	<b>4 794</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 30/06/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	278	375	20	2	675
Origination 2006	276	140	175	15	606
Origination 2007	504	52	330	50	936
Origination depuis 2008	879		869	829	2 577
<b>Total</b>	<b>1 937</b>	<b>567</b>	<b>1 394</b>	<b>896</b>	<b>4 794</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 juin 2014, la valeur comptable des RMBS couverts par des CDS s'élève à 72 millions d'euros. Celle des CLO couverts par des CDS s'élève à 262 millions d'euros. Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 juin 2014, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 303 millions d'euros.