

Information trimestrielle mars 2011 – 12 mai 2011



CIC

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



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/11	Valeur comptable 31/12/10
RMBS	4 999	5 579
CMBS	411	458
CLO	1 686	1 887
Autres ABS	1 009	828
CLO couverts par des CDS	723	833
Autres ABS couverts par des CDS	32	49
Lignes de liquidité des programmes ABCP	365	334
Total	9 225	9 968

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



Exposition au 31 mars 2011

Valeur comptable 31/03/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 700	345	21	295	2 361
Available for sale	1 548	61	194	498	2 301
Loans	1 751	5	1 471	216	3 443
Total	4 999	411	1 686	1 009	8 105
France	14	1		474	489
Europe hors France	3 192	19	689	451	4 351
USA	1 602	333	997	23	2 955
Autres	191	58		61	310
Total	4 999	411	1 686	1 009	8 105
US Agencies	621				621
AAA	2 944	368	717	642	4 671
AA	210	26	741	120	1 097
A	162	15	191	45	413
BBB	138		27	147	312
BB	58	2	10	26	96
Inférieur ou égal à B	866			29	895
Non noté					
Total	4 999	411	1 686	1 009	8 105



Exposition au 31 décembre 2010

Valeur comptable 31/12/10	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 819	306	23	343	2 491
Available for sale	1 835	147	29	287	2 298
Loans	1 925	5	1 835	198	3 963
Total	5 579	458	1 887	828	8 752
France	14	1		407	422
Europe hors France	2 803	84	889	377	4 153
USA	2 366	291	998		3 655
Autres	396	82		44	522
Total	5 579	458	1 887	828	8 752
US Agencies	1 075				1 075
AAA	2 984	346	1 070	601	5 001
AA	322	92	600	56	1 070
A	69	20	179	7	275
BBB	71		26	151	248
BB	43		12	13	68
Inférieur ou égal à B	1 015				1 015
Non noté	0				
Total	5 579	458	1 887	828	8 752



Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	974	23	132	288	1 417
Origination 2006	1 858	129	691	348	3 026
Origination 2007	1 288	180	506	116	2 090
Origination depuis 2008	879	79	357	257	1 572
Total	4 999	411	1 686	1 009	8 105



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2011, l'encours des CLO couverts par des CDS s'élève à 723 millions d'euros. Il est de 32 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



Opérations avec des véhicules ad hoc

Au 31 mars 2011, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 365 millions d'euros.



LBO : détail par zone géographique des structures de financements dédiés

LBO <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/11	Valeur comptable 31/12/10
Détail par zone géographique des structures de financements dédiés		
France	1 359	1 548
Europe hors France	334	376
USA	128	127
Autres	61	70
Total	1 882	2 121
Détail par secteur des structures de financements dédiés (en %)		
Transport industriel	28	28
Biens et services industriels	16	16
Construction	11	9
Voyages et loisirs	9	9
Santé	7	9
Télécommunications	6	6
Autres (<5%)	23	23
Total	100	100



LBO : détail par secteur des structures de financements dédiés (en %)

