



CIC

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



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/11	Valeur comptable 30/06/11
RMBS	3 821	4 963
CMBS	458	459
CLO	1 714	1 480
Autres ABS	834	1 001
CLO couverts par des CDS	725	721
Autres ABS couverts par des CDS	29	29
Lignes de liquidité des programmes ABCP	340	362
Total	7 921	9 015

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



Exposition au 30 septembre 2011

Valeur comptable 30/09/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 084	427	25	338	1 874
Available for sale	1 137	26	189	286	1 638
Loans	1 600	5	1 500	210	3 315
Total	3 821	458	1 714	834	6 827
France	13	2		335	350
Espagne	315			230	545
Royaume Uni	476	31		50	557
Europe hors France	1 352	5	701	149	2 207
USA	1 498	394	1 013	24	2 929
Autres	167	26		46	239
Total	3 821	458	1 714	834	6 827
US Agencies	546				546
AAA	1 657	358	819	419	3 253
AA	251	40	666	189	1 146
A	195	48	191	53	487
BBB	191		26	122	339
BB	106	3	12	20	141
Inférieur ou égal à B	875	9		31	915
Non noté					
Total	3 821	458	1 714	834	6 827



Exposition au 30 juin 2011

Valeur comptable 30/06/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 870	422		366	2 658
Available for sale	1 462	32	29	428	1 951
Loans	1 631	5	1 451	207	3 294
Total	4 963	459	1 480	1 001	7 903
France	14	2		404	420
Espagne	325			262	587
Royaume Uni	1 012	31		48	1 091
Europe hors France	1 746	5	694	204	2 649
USA	1 684	389	786	22	2 881
Autres	182	32		61	275
Total	4 963	459	1 480	1 001	7 903
US Agencies	603				603
AAA	2 660	365	724	639	4 388
AA	497	41	530	125	1 193
A	219	43	187	39	488
BBB	88	8	27	148	271
BB	75	2	12	25	114
Inférieur ou égal à B	821			25	846
Non noté					
Total	4 963	459	1 480	1 001	7 903



Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	943	33	95	218	1 289
Origination 2006	1 066	156	724	152	2 098
Origination 2007	1 085	210	534	94	1 923
Origination depuis 2008	727	59	361	370	1 517
Total	3 821	458	1 714	834	6 827

Valeur comptable 30/06/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	967	74	87	268	1 396
Origination 2006	1 728	149	552	288	2 717
Origination 2007	1 083	173	508	103	1 867
Origination depuis 2008	1 185	63	333	342	1 923
Total	4 963	459	1 480	1 001	7 903



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2011, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 725 millions d'euros.

Il est de 29 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2011, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 340 millions d'euros.



LBO : détail par zone géographique des structures de financements dédiés

LBO <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/11	Valeur comptable 30/06/11
Détail par zone géographique des structures de financements dédiés		
France	1 619	1 491
Europe hors France	306	282
USA	118	87
Autres	40	61
Total	2 083	1 921
Détail par secteur des structures de financements dédiés (en %)		
Transport industriel	32	30
Biens et services industriels	14	15
Voyages et loisirs	8	10
Construction	7	7
Santé	6	6
Distribution	6	5
Télécommunications	5	6
Autres (<5%)	22	21
Total	100	100



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

