

Information trimestrielle mars 2012 – 11 mai 2012



**CIC**

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

*Chiffres non audités*



<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	3 359	3 985
CMBS	369	366
CLO	1 233	1 522
Autres ABS	681	897
CLO couverts par des CDS	709	721
Autres ABS couverts par des CDS	26	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	334	351
<b>Total</b>	<b>6 711</b>	<b>7 870</b>

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



## Exposition au 31 mars 2012

Valeur comptable 31/03/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 189	295	21	380	1 885
Available for sale	762	74	184	97	1 117
Loans	1 408		1 028	204	2 640
<b>Total</b>	<b>3 359</b>	<b>369</b>	<b>1 233</b>	<b>681</b>	<b>5 642</b>
France	3	2		305	310
Espagne	269			182	451
Royaume Uni	455	17		50	522
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	1 134	65	694	120	2 013
USA	1 382	276	539	24	2 221
Autres	116	9			125
<b>Total</b>	<b>3 359</b>	<b>369</b>	<b>1 233</b>	<b>681</b>	<b>5 642</b>
US Agencies	466				466
AAA	889	263	432	398	1 982
AA	779	18	712	48	1 557
A	101	82	51	67	301
BBB	99		26	120	245
BB	163		12	20	195
Inférieur ou égal à B	862	6		28	896
Non noté					
<b>Total</b>	<b>3 359</b>	<b>369</b>	<b>1 233</b>	<b>681</b>	<b>5 642</b>



## Exposition au 31 mars 2012

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		1 305	304	3 454
<b>Total</b>	<b>3 985</b>	<b>366</b>	<b>1 522</b>	<b>897</b>	<b>6 770</b>
France	14	2		353	369
Espagne	305			206	511
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>1 522</b>	<b>897</b>	<b>6 770</b>
US Agencies	521				521
AAA	1 560	303	716	421	3 000
AA	187	30	717	107	1 041
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>1 522</b>	<b>897</b>	<b>6 770</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	692	90	31	123	936
Origination 2006	874	97	418	73	1 462
Origination 2007	1 057	144	429	80	1 710
Origination depuis 2008	736	38	355	405	1 534
<b>Total</b>	<b>3 359</b>	<b>369</b>	<b>1 233</b>	<b>681</b>	<b>5 642</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 709 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 31 mars 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 334 millions d'euros.