

Information trimestrielle septembre 2012 – 14 novembre 2012



CIC

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

Les chiffres figurants dans cette présentation ne sont pas audités.



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	2 715	3 985
CMBS	345	366
CLO	951	1 522
Autres ABS	629	897
CLO couverts par des CDS	856	721
Autres ABS couverts par des CDS	26	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	337	351
Total	5 859	7 870

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



Exposition au 30 septembre 2012

Valeur comptable 30/09/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 035	276		405	1 716
Available for sale	566	69	29	83	747
Loans	1 114		922	141	2 177
Total	2 715	345	951	629	4 640
France	3	2		421	426
Espagne	110			84	194
Royaume Uni	344	19		51	414
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	788	64	681	48	1 581
USA	1 360	255	270	25	1 910
Autres	110	5			115
Total	2 715	345	951	629	4 640
US Agencies	517				517
AAA	615	247	373	350	1 585
AA	277	19	489	77	862
A	269	13	63	137	482
BBB	61	64	12	15	152
BB	143		14	21	178
Inférieur ou égal à B	833	2		29	864
Non noté					
Total	2 715	345	951	629	4 640



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		1 305	304	3 454
Total	3 985	366	1 522	897	6 770
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
Total	3 985	366	1 522	897	6 770
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					
Total	3 985	366	1 522	897	6 770



Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	478	101		35	614
Origination 2006	613	84	197	51	945
Origination 2007	808	155	423	69	1 455
Origination depuis 2008	816	5	331	474	1 626
Total	2 715	345	951	629	4 640



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 856 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 septembre 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 337 millions d'euros.