

Information trimestrielle mars 2015 – 12 mai 2015



CIC

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

Chiffres non audités



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/15	Valeur comptable 31/12/14
RMBS	2 470	2 012
CMBS	635	605
CLO	1 435	1 246
Autres ABS	1 605	1 242
RMBS couverts par des CDS		62
CLO couverts par des CDS	94	142
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	280	199
Total	6 519	5 508

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



Exposition au 31 mars 2015

Valeur comptable 31/03/15	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	399	336	166	126	1 027
Available for sale	1 341	299	899	1 112	3 651
Loans	730		370	367	1 467
Total	2 470	635	1 435	1 605	6 145
France	14			398	412
Espagne	73		11	64	148
Royaume Uni	418			146	564
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	1 021	59	782	979	2 841
USA	923	576	408	18	1 925
Autres	21		234		255
Total	2 470	635	1 435	1 605	6 145
US Agencies	386				386
AAA	1 075	576	1 329	946	3 926
AA	258		18	432	708
A	120		73	159	352
BBB	57	59	3	51	170
BB	12		4		16
Inférieur ou égal à B	562			17	579
Non noté			8		8
Total	2 470	635	1 435	1 605	6 145



Exposition au 31 décembre 2014

Valeur comptable 31/12/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	413	386	152	151	1 102
Available for sale	887	219	726	942	2 774
Loans	712		368	149	1 229
Total	2 012	605	1 246	1 242	5 105
France	16			367	383
Espagne	72		13	38	123
Royaume Uni	211			144	355
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	837	59	692	678	2 266
USA	849	546	331	15	1 741
Autres	27		210		237
Total	2 012	605	1 246	1 242	5 105
US Agencies	346				346
AAA	779	532	1 125	874	3 310
AA	72		29	188	289
A	216	14	72	109	411
BBB	60	59	9	55	183
BB	30		3		33
Inférieur ou égal à B	509			16	525
Non noté			8		8
Total	2 012	605	1 246	1 242	5 105



Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/15	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	258	353	7	3	621
Origination 2006-2008	1 054	282	371	52	1 759
Origination 2009-2011	427			94	521
Origination 2012-2014	731		1 057	1 456	3 244
Total	2 470	635	1 435	1 605	6 145



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2015, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 94 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2015, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 280 millions d'euros.