



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



TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/15	Valeur comptable 31/12/14
RMBS	2 394	2 012
CMBS	376	605
CLO	1 620	1 246
Autres ABS	1 503	1 242
RMBS couverts par des CDS		62
CLO couverts par des CDS	41	142
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS	263	
Lignes de liquidité des programmes ABCP	223	199
Total	6 420	5 508

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

Exposition au 30 septembre 2015

Valeur comptable 30/09/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	565	110	143	127	945
Available for sale	1 175	266	1 182	1 223	3 846
Loans	654		295	153	1 102
Total	2 394	376	1 620	1 503	5 893
France	14			421	435
Espagne	89			52	141
Royaume Uni	465	19	45	140	669
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	752	60	941	873	2 626
USA	1 067	297	424	17	1 805
Autres	7		210		217
Total	2 394	376	1 620	1 503	5 893
US Agencies	592				592
AAA	865	323	1 576	932	3 696
AA	274		3	316	593
A	97		16	176	289
BBB	51	53	4	62	170
BB	24		2		26
Inférieur ou égal à B	491		2	17	510
Non noté			17		17
Total	2 394	376	1 620	1 503	5 893

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 30/09/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	235	62	1		298
Origination 2006-2008	881	288	245	50	1 464
Origination 2009-2011	293			43	336
Origination 2012-2014	985	26	1 374	1 410	3 795
Total	2 394	376	1 620	1 503	5 893



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2015, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 41 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2015, les lignes de liquidité accordées à des programmes RMBS représentent 263 millions d'euros et les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 223 millions d'euros.