

Information trimestrielle septembre 2014 – 14 novembre 2014



CIC

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



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/09/14	Valeur comptable 31/12/13
RMBS	2 010	1 919
CMBS	542	558
CLO	1 424	1 462
Autres ABS	1 180	733
RMBS couverts par des CDS	67	
CLO couverts par des CDS	113	476
Autres ABS couverts par des CDS		22
Lignes de liquidité des programmes ABCP	323	304
Total	5 659	5 474

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



Exposition au 30 septembre 2014

Valeur comptable 30/09/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	623	470	151	246	1 490
Available for sale	701	72	642	789	2 204
Loans	686		631	145	1 462
Total	2 010	542	1 424	1 180	5 156
France	18			317	335
Espagne	91		14	36	141
Royaume Uni	260			189	449
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	851	59	923	599	2 432
USA	755	483	125	15	1 378
Autres	35		362	24	421
Total	2 010	542	1 424	1 180	5 156
US Agencies	284				284
AAA	862	463	1 017	844	3 186
AA	73		315	136	524
A	195	21	67	115	398
BBB	89	58	9	59	215
BB	28		4		32
Inférieur ou égal à B	479			26	505
Non noté			12		12
Total	2 010	542	1 424	1 180	5 156



Exposition au 31 décembre 2013

Valeur comptable 31/12/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	700	498	133	294	1 625
Available for sale	450	60	520	295	1 325
Loans	769		809	144	1 722
Total	1 919	558	1 462	733	4 672
France		2		376	378
Espagne	106			22	128
Royaume Uni	259			55	314
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	806	75	1 008	266	2 155
USA	696	481	123	14	1 314
Autres	52		331		383
Total	1 919	558	1 462	733	4 672
US Agencies	243				243
AAA	618	472	971	492	2 553
AA	209		413	65	687
A	203	19	41	124	387
BBB	89	67	12	27	195
BB	72		17		89
Inférieur ou égal à B	485			25	510
Non noté			8		8
Total	1 919	558	1 462	733	4 672



Expositions par origination

Valeur comptable 30/09/14	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	237	353	9	7	606
Origination 2006	273	152	137	14	576
Origination 2007	636	37	302	51	1 026
Origination depuis 2008	864		976	1 108	2 948
Total	2 010	542	1 424	1 180	5 156



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2014, la valeur comptable des RMBS couverts par des CDS s'élève à 67 millions d'euros. Celle des CLO couverts par des CDS s'élève à 113 millions d'euros. Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2014, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 323 millions d'euros.