

Information semestrielle juin 2015 - 30 juillet 2015



**CIC**

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



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 30/06/15	Valeur comptable 31/12/14
RMBS	2 354	2 012
CMBS	470	605
CLO	1 639	1 246
Autres ABS	1 498	1 242
RMBS couverts par des CDS	0	62
CLO couverts par des CDS	89	142
Autres ABS couverts par des CDS	0	
Lignes de liquidité des programmes ABCP	212	199
<b>Total</b>	<b>6 262</b>	<b>5 508</b>

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



## Exposition au 30 juin 2015

Valeur comptable 30/06/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	465	209	155	133	962
Available for sale	1 202	261	1 138	1 214	3 815
Loans	687		346	151	1 184
<b>Total</b>	<b>2 354</b>	<b>470</b>	<b>1 639</b>	<b>1 498</b>	<b>5 961</b>
France	11			411	422
Espagne	93			58	151
Royaume Uni	490			125	615
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	864	66	947	887	2 764
USA	880	404	472	17	1 773
Autres	16		220		236
<b>Total</b>	<b>2 354</b>	<b>470</b>	<b>1 639</b>	<b>1 498</b>	<b>5 961</b>
US Agencies	380				380
AAA	972	411	1 588	880	3 851
AA	294		6	344	644
A	103		19	192	314
BBB	63	59	4	65	191
BB	22		2	17	41
Inférieur ou égal à B	520		2		522
Non noté			18		18
<b>Total</b>	<b>2 354</b>	<b>470</b>	<b>1 639</b>	<b>1 498</b>	<b>5 961</b>



## 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
<b>Total</b>	<b>2 012</b>	<b>605</b>	<b>1 246</b>	<b>1 242</b>	<b>5 105</b>
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
<b>Total</b>	<b>2 012</b>	<b>605</b>	<b>1 246</b>	<b>1 242</b>	<b>5 105</b>
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
<b>Total</b>	<b>2 012</b>	<b>605</b>	<b>1 246</b>	<b>1 242</b>	<b>5 105</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 30/06/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	255	157	3	1	416
Origination 2006-2008	943	306	310	51	1 610
Origination 2009-2011	420			58	478
Origination 2012-2014	736	7	1 326	1 388	3 457
<b>Total</b>	<b>2 354</b>	<b>470</b>	<b>1 639</b>	<b>1 498</b>	<b>5 961</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 30 juin 2015, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 89 millions d'euros.  
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 juin 2015, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 212 millions d'euros.