



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

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/12/15	Valeur comptable 31/12/14
RMBS	3 198	2 012
CMBS	412	605
CLO	1 666	1 246
Autres ABS	1 564	1 242
RMBS couverts par des CDS		62
CLO couverts par des CDS	38	142
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	223	199
<b>Total</b>	<b>7 101</b>	<b>5 508</b>

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

## Exposition au 31 décembre 2015

Valeur comptable 31/12/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 078	70	135	52	1 335
Available for sale	1 482	342	1 267	1 337	4 428
Loans	638		264	175	1 077
<b>Total</b>	<b>3 198</b>	<b>412</b>	<b>1 666</b>	<b>1 564</b>	<b>6 840</b>
France	9		22	379	410
Espagne	85			51	136
Royaume Uni	374	19	50	189	632
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	740	60	553	928	2 281
USA	1 983	333	769	17	3 102
Autres	7		272		279
<b>Total</b>	<b>3 198</b>	<b>412</b>	<b>1 666</b>	<b>1 564</b>	<b>6 840</b>
US Agencies	1 514				1 514
AAA	800	359	1 625	998	3 782
AA	266			327	593
A	92		16	161	269
BBB	40	53	4	61	158
BB	31		2		33
Inférieur ou égal à B	455		2	17	474
Non noté			17		17
<b>Total</b>	<b>3 198</b>	<b>412</b>	<b>1 666</b>	<b>1 564</b>	<b>6 840</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 31/12/2015 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	363	53	0		416
Origination 2006-2008	812	333	195	50	1 390
Origination 2009-2011	248			37	285
Origination 2012-2014	1 775	26	1 471	1 477	4 749
<b>Total</b>	<b>3 198</b>	<b>412</b>	<b>1 666</b>	<b>1 564</b>	<b>6 840</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 31 décembre 2015, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 38 millions d'euros.  
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 décembre 2015, il n'y a pas de lignes de liquidité accordées à des programmes RMBS et les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 223 millions d'euros.