

Information trimestrielle mars 2016 - 12 mai 2016



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

Chiffres non audités



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/16	Valeur comptable 31/12/15
RMBS	2 638	3 198
CMBS	306	412
CLO	1 726	1 666
Autres ABS	1 462	1 564
RMBS couverts par des CDS		
CLO couverts par des CDS	15	38
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	223	223
Total	6 370	7 101

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



Exposition au 31 mars 2016

Valeur comptable 31/03/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	259	20	127	47	453
Available for sale	1 787	286	1 359	1 364	4 796
Loans	592		240	51	883
Total	2 638	306	1 726	1 462	6 132
France	6		22	263	291
Espagne	80			121	201
Royaume Uni	469	18	69	188	744
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	736	62	554	890	2 242
USA	1 342	226	577		2 145
Autres	5		504		509
Total	2 638	306	1 726	1 462	6 132
US Agencies	911				911
AAA	850	255	1 676	919	3 700
AA	301		8	435	744
A	89		16	51	156
BBB	39	51	4	57	151
BB	29		2		31
Inférieur ou égal à B	419		2		421
Non noté			18		18
Total	2 638	306	1 726	1 462	6 132



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
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840
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
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840
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
Total	3 198	412	1 666	1 564	6 840



Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	183	51			234
Origination 2006-2008	815	226	167	32	1 240
Origination 2009-2011	223			31	254
Origination 2012-2014	1 417	29	1 559	1 399	4 404
Total	2 638	306	1 726	1 462	6 132



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2016, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 15 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2016, 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.