

Information trimestrielle mars 2012 – 11 mai 2012



CIC

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

Chiffres non audités



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/12	Valeur comptable 31/12/11
RMBS	3 359	3 985
CMBS	369	366
CLO	1 233	1 522
Autres ABS	681	897
CLO couverts par des CDS	709	721
Autres ABS couverts par des CDS	26	28
Lignes de liquidité des programmes ABCP	334	351
Total	6 711	7 870

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



Exposition au 31 mars 2012

Valeur comptable 31/03/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 189	295	21	380	1 885
Available for sale	762	74	184	97	1 117
Loans	1 408		1 028	204	2 640
Total	3 359	369	1 233	681	5 642
France	3	2		305	310
Espagne	269			182	451
Royaume Uni	455	17		50	522
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	1 134	65	694	120	2 013
USA	1 382	276	539	24	2 221
Autres	116	9			125
Total	3 359	369	1 233	681	5 642
US Agencies	466				466
AAA	889	263	432	398	1 982
AA	779	18	712	48	1 557
A	101	82	51	67	301
BBB	99		26	120	245
BB	163		12	20	195
Inférieur ou égal à B	862	6		28	896
Non noté					
Total	3 359	369	1 233	681	5 642



Exposition au 31 mars 2012

Valeur comptable 31/12/11	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 173	353	25	366	1 917
Available for sale	967	13	192	227	1 399
Loans	1 845		1 305	304	3 454
Total	3 985	366	1 522	897	6 770
France	14	2		353	369
Espagne	305			206	511
Royaume Uni	413	31		52	496
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	1 306		694	144	2 144
USA	1 795	320	828	121	3 064
Autres	152	13		21	186
Total	3 985	366	1 522	897	6 770
US Agencies	521				521
AAA	1 560	303	716	421	3 000
AA	187	30	717	107	1 041
A	242	23	51	97	413
BBB	145	2	26	121	294
BB	119		12	20	151
Inférieur ou égal à B	1 211	8		131	1 350
Non noté					
Total	3 985	366	1 522	897	6 770



Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	692	90	31	123	936
Origination 2006	874	97	418	73	1 462
Origination 2007	1 057	144	429	80	1 710
Origination depuis 2008	736	38	355	405	1 534
Total	3 359	369	1 233	681	5 642



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2012, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 709 millions d'euros.

Il est de 26 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2012, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 334 millions d'euros.