



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



TITRISATION

| TITRISATION <i>(en millions €)</i> | Valeur comptable 30/09/15 | Valeur comptable 31/12/14 |
|--|---------------------------------|---------------------------------|
| RMBS | 2 394 | 2 012 |
| CMBS | 376 | 605 |
| CLO | 1 620 | 1 246 |
| Autres ABS | 1 503 | 1 242 |
| RMBS couverts par des CDS | | 62 |
| CLO couverts par des CDS | 41 | 142 |
| Autres ABS couverts par des CDS | | |
| Lignes de liquidité des programmes RMBS | 263 | |
| Lignes de liquidité des programmes ABCP | 223 | 199 |
| Total | 6 420 | 5 508 |

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

Exposition au 30 septembre 2015

| Valeur comptable 30/09/2015 (en millions €) | RMBS | CMBS | CLO | Autres ABS | Total |
|--|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|
| Trading | 565 | 110 | 143 | 127 | 945 |
| Available for sale | 1 175 | 266 | 1 182 | 1 223 | 3 846 |
| Loans | 654 | | 295 | 153 | 1 102 |
| Total | 2 394 | 376 | 1 620 | 1 503 | 5 893 |
| France | 14 | | | 421 | 435 |
| Espagne | 89 | | | 52 | 141 |
| Royaume Uni | 465 | 19 | 45 | 140 | 669 |
| Europe hors France, Espagne, Royaume Uni | 752 | 60 | 941 | 873 | 2 626 |
| USA | 1 067 | 297 | 424 | 17 | 1 805 |
| Autres | 7 | | 210 | | 217 |
| Total | 2 394 | 376 | 1 620 | 1 503 | 5 893 |
| US Agencies | 592 | | | | 592 |
| AAA | 865 | 323 | 1 576 | 932 | 3 696 |
| AA | 274 | | 3 | 316 | 593 |
| A | 97 | | 16 | 176 | 289 |
| BBB | 51 | 53 | 4 | 62 | 170 |
| BB | 24 | | 2 | | 26 |
| Inférieur ou égal à B | 491 | | 2 | 17 | 510 |
| Non noté | | | 17 | | 17 |
| Total | 2 394 | 376 | 1 620 | 1 503 | 5 893 |

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 |
| Total | 2 012 | 605 | 1 246 | 1 242 | 5 105 |
| 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 |
| Total | 2 012 | 605 | 1 246 | 1 242 | 5 105 |
| 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 |
| Total | 2 012 | 605 | 1 246 | 1 242 | 5 105 |

Expositions par origination

| Valeur comptable 30/09/2015 (en millions €) | RMBS | CMBS | CLO | Autres ABS | Total |
|--|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|
| Origination 2005 et avant | 235 | 62 | 1 | | 298 |
| Origination 2006-2008 | 881 | 288 | 245 | 50 | 1 464 |
| Origination 2009-2011 | 293 | | | 43 | 336 |
| Origination 2012-2014 | 985 | 26 | 1 374 | 1 410 | 3 795 |
| Total | 2 394 | 376 | 1 620 | 1 503 | 5 893 |



Expositions couvertes par des CDS

Au 30 septembre 2015, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS. La valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 41 millions d'euros.
Il n'y a pas d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 30 septembre 2015, les lignes de liquidité accordées à des programmes RMBS représentent 263 millions d'euros et les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 223 millions d'euros.