

Information trimestrielle mars 2013 – 14 mai 2013



**CIC**

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

*Chiffres non audités*



## TITRISATION

<b>TITRISATION</b> <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/13	Valeur comptable 31/12/12
RMBS	2 551	2 391
CMBS	352	333
CLO	963	943
Autres ABS	734	731
CLO couverts par des CDS	757	833
Autres ABS couverts par des CDS	23	25
Lignes de liquidité des programmes ABCP	273	351
<b>Total</b>	<b>5 653</b>	<b>5 607</b>

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



## Exposition au 31 mars 2013

Valeur comptable 31/03/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	1 017	289	34	513	1 853
Available for sale	465	63	29	68	625
Loans	1 069		900	153	2 122
<b>Total</b>	<b>2 551</b>	<b>352</b>	<b>963</b>	<b>734</b>	<b>4 600</b>
France		2		480	482
Espagne	106			55	161
Royaume Uni	221			56	277
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	975	63	656	118	1 812
USA	1 153	287	307	25	1 772
Autres	96				96
<b>Total</b>	<b>2 551</b>	<b>352</b>	<b>963</b>	<b>734</b>	<b>4 600</b>
US Agencies	377				377
AAA	726	265	410	480	1 881
AA	249		481	43	773
A	198	24	47	143	412
BBB	88	63	12	21	184
BB	84		13		97
Inférieur ou égal à B	829			47	876
Non noté					
<b>Total</b>	<b>2 551</b>	<b>352</b>	<b>963</b>	<b>734</b>	<b>4 600</b>



## Exposition au 31 décembre 2012

Valeur comptable 31/12/12	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	921	269	15	505	1 710
Available for sale	478	64	29	75	646
Loans	992		899	151	2 042
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>
France	1	2		519	522
Espagne	105			68	173
Royaume Uni	244			47	291
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	706	64	664	72	1 506
USA	1 232	267	279	25	1 803
Autres	103				103
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>
US Agencies	447				447
AAA	546	259	383	462	1 650
AA	239		488	53	780
A	188	10	47	150	395
BBB	66	64	12	19	161
BB	101		13		114
Inférieur ou égal à B	804			47	851
Non noté					
<b>Total</b>	<b>2 391</b>	<b>333</b>	<b>943</b>	<b>731</b>	<b>4 398</b>



## Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/13	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	418	144		23	585
Origination 2006	577	67	173	38	855
Origination 2007	829	141	425	53	1 448
Origination depuis 2008	727		365	620	1 712
<b>Total</b>	<b>2 551</b>	<b>352</b>	<b>963</b>	<b>734</b>	<b>4 600</b>



## Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2013, la valeur comptable des CLO couverts par des CDS s'élève à 757 millions d'euros.

Il est de 23 millions d'euros pour les autres ABS couverts par les CDS.



## Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2013, les lignes de liquidité accordées à des programmes ABCP représentent 273 millions d'euros.