

Information trimestrielle mars 2017 - 11 mai 2017



CIC

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

Chiffres non audités



TITRISATION

TITRISATION <i>(en millions €)</i>	Valeur comptable 31/03/17	Valeur comptable 31/12/16
RMBS	2 209	2 798
CMBS	55	51
CLO	1 840	2 075
Autres ABS	1 601	1 640
RMBS couverts par des CDS		
CLO couverts par des CDS		5
Autres ABS couverts par des CDS		
Lignes de liquidité des programmes RMBS		
Lignes de liquidité des programmes ABCP	185	185
Total	5 890	6 754

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



Exposition au 31 mars 2017

Valeur comptable 31/03/2017 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	204	5	95	82	386
Available for sale	1 498	50	1 634	1 291	4 473
Loans	507		111	228	846
Total	2 209	55	1 840	1 601	5 705
France	221		67	421	709
Espagne	97			107	204
Royaume Uni	254		43	196	493
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	445	55	386	877	1 763
USA	1 177		661		1 838
Autres	15		683		698
Total	2 209	55	1 840	1 601	5 705
US Agencies	796				796
AAA	695		1 751	909	3 355
AA	230		52	467	749
A	76		22		98
BBB	26	55	4	225	310
BB	27				27
Inférieur ou égal à B	359				359
Non noté			11		11
Total	2 209	55	1 840	1 601	5 705



Exposition au 31 décembre 2016

Valeur comptable 31/12/2016 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Trading	762		113	47	922
Available for sale	1 501	51	1 814	1 367	4 733
Loans	535		148	226	909
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564
France	130		58	412	600
Espagne	72			116	188
Royaume Uni	295		85	162	542
Europe hors France, Espagne, Royaume Uni	450	51	436	950	1 887
USA	1 850		894		2 744
Autres	1		602		603
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564
US Agencies	1 451				1 451
AAA	686		1 990	972	3 648
AA	157		48	425	630
A	62		22	13	97
BBB	31	51	4	230	316
BB	31				31
Inférieur ou égal à B	380				380
Non noté			11		11
Total	2 798	51	2 075	1 640	6 564



Expositions par origination

Valeur comptable 31/03/2017 (en millions €)	RMBS	CMBS	CLO	Autres ABS	Total
Origination 2005 et avant	151	55			206
Origination 2006-2008	622		25	32	679
Origination 2009-2011	156				156
Origination 2012-2016	1 280		1 815	1 569	4 664
Total	2 209	55	1 840	1 601	5 705



Expositions couvertes par des CDS

Au 31 mars 2017, il n'y a pas de RMBS couverts par des CDS, de CLO couverts par des CDS et d'autres ABS couverts par les CDS.



Lignes de liquidité de programmes ABCP

Au 31 mars 2017, 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 185 millions d'euros.