

SOMMAIRE ANNEXES

- 1 – Double échelle de classement des risques « charte Gissler »,
- 2 – Etat de la dette – Répartition de l'encours (Typologie),
- 3 – Etat du notionnel de référence.

Double échelle de classement des risques de la charte " Gissler"

	Indices sous-jacents
1	Indices zone euro
2	Indices inflation française ou inflation zone euro ou écarts entre ces indices
3	Écarts d'indices zone euro
4	Indices hors zone euro. Écarts d'indices dont l'un est un indice hors zone euro
5	Écarts d'indices hors zone euro
6	Autres indices

	Structures
A	Taux fixe simple. Taux variable simple. Echange de taux fixe contre taux variable ou inversement. Echange de taux structuré contre taux variable ou taux fixe (sens unique). Taux variable simple plafonné (cap) ou encadré (tunnel)
B	Barrière simple. Pas d'effet de levier
C	Option d'échange (swaption)
D	Multiplicateur jusqu'à 3; multiplicateur jusqu'à 5 capé
E	Multiplicateur jusqu'à 5
F	Autres types de structures

IV - ANNEXES							IV
ELEMENTS DU BILAN - ETAT DE LA DETTE REPARTITION DE L'ENCOURS (TYPOLOGIE)							
Structures	Indices sous-jacents	(1) indices en euros	(2) Indices inflation française ou zone euro ou écart entre ces indices	(3) Ecart d'indices zone euro	(4) Indices hors zone euro et écarts d'indices dont l'un est un indice hors zone euro	(5) Ecart d'indices hors zone euro	(6) Autres indices
	(A) Taux fixe simple. Taux variable simple. Echange de taux fixe contre taux variable ou inversement. Echange de taux structuré contre taux variable ou taux fixe (sens unique). Taux variable simple plafonné (cap) ou encadré (tunnel)	Nombre de produits	56	-	-	-	-
% de l'encours		100,00%	-	-	-	-	-
Montant en euros		727 858 505,19 €	-	-	-	-	-
(B) Barrière simple. Pas d'effet de levier		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
(C) Option d'échange (swaption)		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
(D) Multiplicateur jusqu'à 3; multiplicateur jusqu'à 5 capé		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
(E) Multiplicateur jusqu'à 5		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
(F) Autres types de structures		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-

Taux de change réel.

Conseil Départemental des Bouches-du-Rhône du 31 mars 2017 - Rapport n° 48

Etat du notionnel de référence (Annexe 3)

Nature de la dette	Année d'encours	Organisme prêteur ou chef de file	Dette en capital à l'origine	Capital restant dû au 01/01/2017	Taux	Périodicité du remboursement	Annuité de l'exercice 2016	
					F/V		Intérêts	Capital
16311 Emprunts obligataires	10/05/2016	GFI Limited Securities	15 000 000,00	15 000 000,00	F	X	0,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	30/10/2015	Crédit Agricole CIB	18 000 000,00	18 000 000,00	F	X	371 091,15	0,00
16311 Emprunts obligataires	29/10/2015	Crédit Mutuel Arkéa	10 000 000,00	10 000 000,00	F	X	78 426,23	0,00
16311 Emprunts obligataires	25/03/2014	Crédit Mutuel Arkéa	20 000 000,00	20 000 000,00	V	X	80 020,56	0,00
16311 Emprunts obligataires	11/12/2013	Deutsche Bank	20 000 000,00	20 000 000,00	F	X	720 000,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	08/07/2016	GFI Limited Securities	10 000 000,00	10 000 000,00	F	X	0,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	25/09/2014	HSBC	20 000 000,00	20 000 000,00	F	X	472 888,52	0,00
16311 Emprunts obligataires	27/11/2013	HSBC	10 000 000,00	10 000 000,00	F	X	322 500,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	26/03/2014	HSBC	10 000 000,00	10 000 000,00	F	X	194 000,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	31/07/2014	HSBC	15 000 000,00	15 000 000,00	F	X	408 000,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	26/03/2014	HSBC	20 000 000,00	20 000 000,00	F	X	670 000,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	13/06/2016	Nomura	10 000 000,00	10 000 000,00	F	X	0,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	02/06/2015	Nomura	20 000 000,00	20 000 000,00	F	X	192 800,00	0,00
16311 Emprunts obligataires	10/11/2015	Société Générale	25 000 000,00	25 000 000,00	F	X	487 500,00	0,00
16311 Emprunts obligataires				223 000 000,00			3 997 226,46	0,00
1641 Emprunts en euros	12/12/2014	La Banque Postale	10 000 000,00	8 833 333,31	V	T	99 450,73	666 666,68
1641 Emprunts en euros	04/01/2016	La Banque Postale	40 000 000,00	37 999 999,99	V	T	254 442,23	2 000 000,01
1641 Emprunts en euros	30/12/2013	La Banque Postale	10 000 000,00	8 000 000,00	V	A	128 388,75	1 000 000,00
1641 Emprunts en euros	30/06/2015	La Banque Postale	30 000 000,00	27 500 000,00	V	T	222 141,67	2 000 000,00
1641 Emprunts en euros	17/09/2012	Caisse Autonome de Retraite des Anciens Combattants	10 000 000,00	7 333 333,32	F	A	381 600,00	666 666,67
1641 Emprunts en euros	12/12/2014	Crédit Coopératif	10 000 000,00	0,00	V	T	90 999,17	9 542 604,55
1641 Emprunts en euros	25/01/2012	Caisse d'Epargne	2 000 000,00	1 589 797,78	F	A	77 488,35	109 508,25
1641 Emprunts en euros	10/08/2012	Caisse d'Epargne	20 000 000,00	15 978 573,49	F	A	834 088,79	1 078 456,90
1641 Emprunts en euros	25/01/2012	Caisse des Dépôts et Consignations	20 000 000,00	15 885 664,57	F	A	765 945,73	1 097 610,95
1641 Emprunts en euros	30/04/2013	Caisse des Dépôts et Consignations	30 000 000,00	25 298 958,55	F	A	1 055 522,60	1 627 638,51
1641 Emprunts en euros	30/01/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	16 600 000,00	15 147 500,00	V	T	272 378,36	830 000,00
1641 Emprunts en euros	29/12/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	14 000 000,00	12 775 000,00	V	T	197 082,34	700 000,00
1641 Emprunts en euros	29/12/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	11 900 000,00	10 858 750,00	V	T	195 259,18	595 000,00
1641 Emprunts en euros	06/07/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	7 900 000,00	7 406 250,00	V	T	133 929,70	395 000,00
1641 Emprunts en euros	04/06/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	1 500 000,00	1 406 250,00	V	T	25 429,70	75 000,00
1641 Emprunts en euros	23/12/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	22 750 000,00	21 896 875,00	V	T	259 936,61	853 125,00
1641 Emprunts en euros	23/12/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	27 700 000,00	26 661 250,00	V	T	271 539,05	1 038 750,00
1641 Emprunts en euros	27/12/2013	Caisse des Dépôts et Consignations	10 053 000,00	8 670 712,50	V	T	157 235,20	502 650,00
1641 Emprunts en euros	27/12/2013	Caisse des Dépôts et Consignations	7 500 000,00	6 843 750,00	V	T	123 867,19	375 000,00
1641 Emprunts en euros	14/12/2016	Caisse des Dépôts et Consignations	30 167 120,00	0,00	F	X	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	01/08/2017	Caisse des Dépôts et Consignations	16 250 000,00	0,00	V	X	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	01/09/2017	Caisse des Dépôts et Consignations	11 250 000,00	0,00	V	X	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	01/09/2017	Caisse des Dépôts et Consignations	12 500 000,00	0,00	V	X	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	01/08/2017	Caisse des Dépôts et Consignations	5 000 000,00	0,00	V	X	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	13/12/2016	Caisse des Dépôts et Consignations	19 519 000,00	0,00	F	A	0,00	0,00
1641 Emprunts en euros	09/04/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	10 000 000,00	9 000 000,00	V	A	190 000,00	500 000,00
1641 Emprunts en euros	09/04/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	7 500 000,00	6 750 000,00	V	A	142 500,00	375 000,00
1641 Emprunts en euros	09/04/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	7 500 000,00	7 125 000,00	V	A	168 750,00	375 000,00
1641 Emprunts en euros	09/04/2014	Caisse des Dépôts et Consignations	7 500 000,00	7 500 000,00	V	A	914,46	0,00
1641 Emprunts en euros	30/11/2011	Crédit Agricole CIB	15 000 000,00	10 000 000,00	V	T	12 420,65	1 000 000,00

Conseil Départemental des Bouches-du-Rhône du 31 mars 2017 - Rapport n° 48

Nature de la dette	Année d'encours	Organisme prêteur ou chef de file	Dette en capital à l'origine	Capital restant dû au 01/01/2017	Taux	Périodicité du remboursement	Annuité de l'exercice 2016	
					F/V		Intérêts	Capital
1641 Emprunts en euros	28/12/2010	Crédit Agricole CIB	20 000 000,00	12 000 000,08	V	T	12 091,72	1 333 333,32
1641 Emprunts en euros	24/12/2003	Crédit Foncier de France	35 000 000,00	7 365 946,03	V	S	0,00	2 748 140,41
1641 Emprunts en euros	23/12/2004	Crédit Foncier de France	20 000 000,00	4 905 569,39	F	A	235 869,60	1 521 103,36
1641 Emprunts en euros	21/12/2005	Depfa Bank	50 000 000,00	37 776 274,28	F	A	1 510 814,14	1 330 217,60
1641 Emprunts en euros	31/07/2015	Deutsche Pfandbriefbank AG	40 000 000,00	36 666 666,65	V	T	289 929,26	2 666 666,68
1641 Emprunts en euros	30/09/2014	Deutsche Pfandbriefbank AG	40 000 000,00	33 999 999,97	V	T	312 629,05	2 666 666,68
1641 Emprunts en euros	27/12/2012	Deutsche Pfandbriefbank AG	30 000 000,00	22 000 000,00	V	T	510 585,77	2 000 000,00
1641 Emprunts en euros	27/03/2013	Deutsche Pfandbriefbank AG	20 000 000,00	15 000 000,00	V	T	347 705,60	1 333 333,33
1641 Emprunts en euros	28/12/2009	Caisse Française de Financement Local	20 000 000,00	10 777 777,87	V	M	11 837,85	1 333 333,32
1641 Emprunts en euros	14/11/2003	Caisse Française de Financement Local	30 000 000,00	5 182 731,03	F	A	335 177,10	2 431 181,10
1641 Emprunts en euros	10/12/2004	Société Générale	50 000 000,00	12 422 541,38	F	A	635 599,52	3 833 200,80
1641 Emprunts en euros				498 558 505,19			10 263 550,07	50 600 854,12
1671 Avances consolidées au Trésor	30/10/2015	Caisse des Dépôts et Consignations	12 600 000,00	6 300 000,00	F	50% en 2016 et 50% en 2017	0,00	6 300 000,00
1671 Avances consolidées au Trésor				6 300 000,00			0,00	6 300 000,00
Total				727 858 505,19			14 260 776,53	56 900 854,12

Répartition de l'encours de dette départementale au 1er janvier 2017

Taux variables	392 185 061,40	46,12%
Taux fixes	335 673 443,79	53,88%
TOTAL	727 858 505,19	

Répartition de l'encours de dette départementale par prêteur au 1er janvier 2017

Caisse des Dépôts et Consignations	189 525 960,62	26,04%
Deutsche Pfandbriefbank AG	107 666 666,62	14,79%
La Banque Postale	82 333 333,30	11,31%
HSBC	75 000 000,00	10,30%
Crédit Agricole CIB	40 000 000,08	5,50%
Depfa Bank	37 776 274,28	5,19%
Société Générale	37 422 541,38	5,14%
Crédit Mutuel Arkéa	30 000 000,00	4,12%
Nomura	30 000 000,00	4,12%
GFI Limited Securities	25 000 000,00	3,43%
Deutsche Bank	20 000 000,00	2,75%
Caisse d'Epargne	17 568 371,27	2,41%
Caisse Française de Financement Local	15 960 508,90	2,19%
Crédit Foncier de France	12 271 515,42	1,69%
Caisse Autonome de Retraite des Anciens Combattants	7 333 333,32	1,01%
TOTAL	727 858 505,19	