

ANNEXE 1 : ETAT NOTIONNEL DE REFERENCE AU 31/12/2019

Conseil Départemental des Bouches-du-Rhône

Prêteur	Capital restant dû	Durée résiduelle	Taux	Année de réalisation	Montant initial	Risque de taux
BANCAIRE	666 139 229,27 €				899 237 320,00 €	
DEPFA BANK	33 464 656,93 €	15,97	Taux fixe à 3.8 %	2005	50 000 000,00 €	Fixe
SFIL CAFFIL	6 777 777,91 €	5,00	(Euribor 1M-Floor -0.41 sur Euribor 1M) + 0.41	2009	20 000 000,00 €	Variable
CREDIT AGRICOLE-CIB	15 000 000,12 €	6,91	Revolving	2010	35 000 000,00 €	Variable
PFAND BRIEF BANK	16 000 000,00 €	7,99	Euribor 3M + 2.4	2012	30 000 000,00 €	Variable
Caisse Autonome de Retraite des Anciens Combattants (CARAC)	5 333 333,31 €	7,71	Taux fixe à 4.77 %	2012	10 000 000,00 €	Fixe
CAISSE D'EPARGNE	12 416 342,14 €	7,65	Taux fixe à 4.89 %	2012	20 000 000,00 €	Fixe
CAISSE D'EPARGNE	1 230 390,38 €	7,42	Taux fixe à 4.56 %	2012	2 000 000,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	12 286 787,29 €	7,08	Taux fixe à 4.51 %	2012	20 000 000,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	20 023 120,04 €	8,00	Taux fixe à 3.92 %	2012	30 000 000,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	5 718 750,00 €	15,00	Livret A + 1	2013	7 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	7 162 762,50 €	14,00	Livret A + 1	2013	10 053 000,00 €	Livret A
LA BANQUE POSTALE	5 000 000,00 €	4,00	Euribor 12M + 1.08	2013	10 000 000,00 €	Variable
PFAND BRIEF BANK	11 000 000,00 €	8,24	Euribor 3M + 2.4	2013	20 000 000,00 €	Variable
LA BANQUE POSTALE	6 833 333,27 €	10,08	Euribor 3M + 1.25	2014	10 000 000,00 €	Variable
PFAND BRIEF BANK	25 999 999,93 €	9,74	Euribor 3M + 1.1	2014	40 000 000,00 €	Variable
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	7 500 000,00 €	14,33	Livret A + 1	2014	10 000 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	5 625 000,00 €	14,33	Livret A + 1	2014	7 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	6 000 000,00 €	15,33	Livret A + 1	2014	7 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	6 375 000,00 €	16,33	Livret A + 1	2014	7 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	10 675 000,00 €	15,00	Livret A + 0.75	2014	14 000 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	9 073 750,00 €	15,00	Livret A + 1	2014	11 900 000,00 €	Livret A
LA BANQUE POSTALE	21 500 000,00 €	10,50	(Euribor 3M + 0.76)-Floor 0 sur Euribor 3M	2015	30 000 000,00 €	Variable
PFAND BRIEF BANK	28 666 666,61 €	10,54	(Euribor 3M + 0.74)-Floor 0 sur Euribor 3M	2015	40 000 000,00 €	Variable
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	6 221 250,00 €	15,51	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2015	7 900 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	1 181 250,00 €	15,51	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2015	1 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	12 657 500,00 €	15,00	Livret A + 1	2015	16 600 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	18 484 375,00 €	16,00	(Livret A + 1)-Floor 0 sur Livret A	2015	22 750 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	22 506 250,00 €	16,00	(Livret A + 0.75)-Floor 0 sur Livret A	2015	27 700 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	14 625 000,00 €	17,00	(Livret A + 0.75)-Floor -0.75 sur Livret A	2016	16 250 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	10 125 000,00 €	17,00	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2016	11 250 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	11 250 000,00 €	17,00	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2016	12 500 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	4 500 000,00 €	17,00	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2016	5 000 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	27 150 408,00 €	17,00	Taux fixe à 0 %	2016	30 167 120,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	29 999 999,95 €	11,08	(Euribor 3M + 0.77)-Floor 0 sur Euribor 3M	2016	40 000 000,00 €	Variable

14 avr 2020

Rapport n° 3

ANNEXE 1 : ETAT NOTIONNEL DE REFERENCE AU 31/12/2019

Conseil Départemental des Bouches-du-Rhône du 14 avr 2020 - Rapport n° 3

Prêteur	Capital restant dû	Durée résiduelle	Taux	Année de réalisation	Montant initial	Risque de taux
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	13 104 993,60 €	17,54	Taux fixe à 0 %	2017	14 561 104,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	4 893 386,40 €	17,54	Taux fixe à 0 %	2017	5 437 096,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	17 567 100,00 €	17,00	Taux fixe à 0 %	2017	19 519 000,00 €	Fixe
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	19 380 000,00 €	18,00	(Livret A + 0.75)-Floor -0.75 sur Livret A	2017	20 400 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	10 545 000,00 €	18,50	(Livret A + 1)-Floor -1 sur Livret A	2018	11 100 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	3 687 563,79 €	18,50	Livret A + 1	2018	3 850 000,00 €	Livret A
BANQUE DES TERRITOIRES (ex-CDC)	4 597 482,12 €	18,50	Livret A + 1	2018	4 800 000,00 €	Livret A
SOCIETE GENERALE	18 999 999,98 €	14,08	(Euribor 3M + 0.34)-Floor 0 sur Euribor 3M	2018	20 000 000,00 €	Variable
BANQUE EUROPEENNE D'INVESTISSEMENT	10 000 000,00 €	24,87	(Euribor 6M + 0.265)-Floor -0.265 sur Euribor 6M	2019	10 000 000,00 €	Variable
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	15,00	Taux fixe à 0.38 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	19,00	Taux fixe à 0.48 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	15,00	Taux fixe à 0.36 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	19,00	Taux fixe à 0.46 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	14,75	Taux fixe à 0.41 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	15,00	Taux fixe à 0.36 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	19,00	Taux fixe à 0.46 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
LA BANQUE POSTALE	10 000 000,00 €	14,75	Taux fixe à 0.43 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
CREDIT COOPERATIF	15 000 000,00 €	14,93	(Euribor 3M + 0.2)-Floor 0 sur Euribor 3M	2019	15 000 000,00 €	Variable
CREDIT COOPERATIF	10 000 000,00 €	14,68	Taux fixe à 0.58 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
SOCIETE GENERALE	20 000 000,00 €	19,97	Taux fixe à 0 % puis Euribor 3M + 0,37 à compter de 2023	2019	20 000 000,00 €	Fixe puis variable
SOCIETE GENERALE	0,00 €	15,25	(Euribor 3M + 0.35)-Floor 0 sur Euribor 3M	2019	15 000 000,00 €	Variable
SOCIETE GENERALE	0,00 €	15,25	(Euribor 3M + 0.35)-Floor 0 sur Euribor 3M	2019	15 000 000,00 €	Variable
OBLIGATAIRE	373 000 000,00 €				373 000 000,00 €	
HSBC	10 000 000,00 €	8,95	Taux fixe à 3.225 %	2013	10 000 000,00 €	Fixe
Deutsche Bank	20 000 000,00 €	16,95	Taux fixe à 3.6 %	2013	20 000 000,00 €	Fixe
HSBC	20 000 000,00 €	12,74	Taux fixe à 2.358 %	2014	20 000 000,00 €	Fixe
HSBC	15 000 000,00 €	17,58	Taux fixe à 2.72 %	2014	15 000 000,00 €	Fixe
HSBC	10 000 000,00 €	1,24	Taux fixe à 1.94 %	2014	10 000 000,00 €	Fixe
HSBC	20 000 000,00 €	17,24	Taux fixe à 3.35 %	2014	20 000 000,00 €	Fixe
CREDIT MUTUEL ARKEA	20 000 000,00 €	0,23	Euribor 3M + 0.63	2014	20 000 000,00 €	Variable
NOMURA	20 000 000,00 €	2,42	Taux fixe à 0.964 %	2015	20 000 000,00 €	Fixe
CREDIT MUTUEL ARKEA	10 000 000,00 €	1,83	Taux fixe à 0.78 %	2015	10 000 000,00 €	Fixe
CREDIT AGRICOLE-CIB	18 000 000,00 €	20,83	Taux fixe à 2.056 %	2015	18 000 000,00 €	Fixe
SOCIETE GENERALE	25 000 000,00 €	16,86	Taux fixe à 1.95 %	2015	25 000 000,00 €	Fixe

ANNEXE 1 : ETAT NOTIONNEL DE REFERENCE AU 31/12/2019

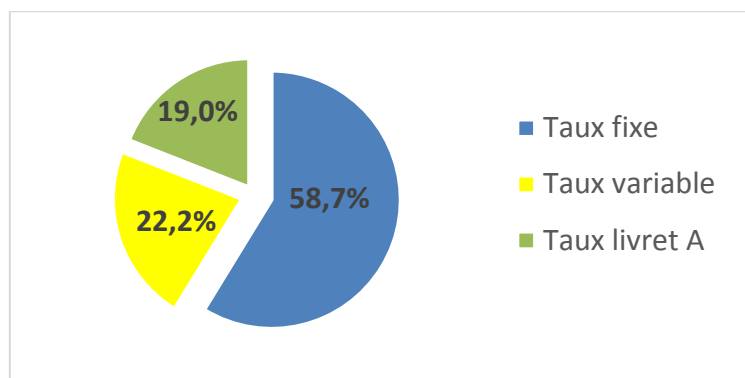
Prêteur	Capital restant dû	Durée résiduelle	Taux	Année de réalisation	Montant initial	Risque de taux
GFI LIMITED	10 000 000,00 €	19,52	Taux fixe à 1.1 %	2016	10 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	15 000 000,00 €	18,36	Taux fixe à 1.865 %	2016	15 000 000,00 €	Fixe
NOMURA	10 000 000,00 €	16,45	Taux fixe à 1.544 %	2016	10 000 000,00 €	Fixe
HSBC	20 000 000,00 €	19,45	Taux fixe à 1.7 %	2017	20 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	10 000 000,00 €	3,85	Taux fixe à 0.253 %	2018	10 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	10 000 000,00 €	7,85	Taux fixe à 0.84 %	2018	10 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	10 000 000,00 €	6,48	Taux fixe à 0.715 %	2018	10 000 000,00 €	Fixe
HSBC	15 000 000,00 €	18,46	Taux fixe à 1.563 %	2018	15 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	20 000 000,00 €	10,96	Taux fixe à 0.31 %	2019	20 000 000,00 €	Fixe
CREDIT AGRICOLE-CIB	15 000 000,00 €	21,96	Taux fixe à 0.81 %	2019	15 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	20 000 000,00 €	15,58	Taux fixe à 0.53 %	2019	20 000 000,00 €	Fixe
HSBC	20 000 000,00 €	24,35	Taux fixe à 1.368 %	2019	20 000 000,00 €	Fixe
GFI LIMITED	10 000 000,00 €	4,34	Taux fixe à 0.11 %	2019	10 000 000,00 €	Fixe
TOTAL	1 039 139 229,27 €				1 412 237 320,00 €	

ANNEXE 2 : PRINCIPALES CARACTERISTIQUES DE L'ENCOURS DE DETTE AU 31/12/2019

Répartition de l'encours de dette par type de taux au 31/12/2019

Taux	Encours concerné (arrondi à l'euro)	% d'exposition
Fixe	610 470 518 €	58,7%
Variable	428 668 711 €	41,3%
<i>dont livret A</i>	<i>197 890 933 €</i>	
Total encours	1 039 139 229 €	

Répartition par nature de risque au 31/12/2019



Taux moyen au 31/12/2019 : 1,42%

Répartition encours de dette par prêteur au 31/12/2019

Prêteur	Montant (arrondi à l'euro)	% du capital restant dû
Banque des Territoires	292.916.729 €	28,2%
La Banque postale	143.333.333 €	13,8%
Deutsche Pfandbriefbank AG	81.666.667 €	7,9%
Société Générale	39.000.000 €	3,8%
Depfa Bank	33.464.657 €	3,2%
Crédit coopératif	25.000.000 €	2,4%
Crédit Agricole & Investment Bank	15.000.000 €	1,4%
Caisse d'Epargne	13.646.732 €	1,3%
BEI	10.000.000 €	1,0%
SFIL CAFFIL	6.777.778 €	0,7%
CARAC	5.333.333 €	0,5%
Emissions obligataires	373.000.000 €	35,9%
TOTAL ENCOURS	1.039.139.229 €	100%

Répartition encours de dette par prêteur au 31/12/2019 représentation graphique

