



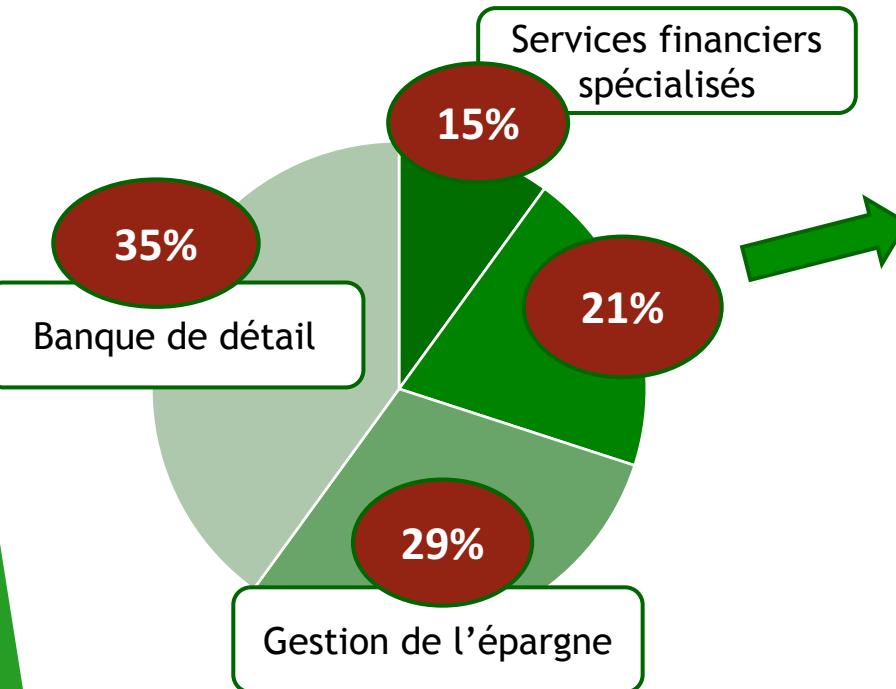
Gestionnaire ALM Opérations

encadré par Vincent CHOULEUR

Présentation



Répartition du PNB par activité



« La Banque verte »

Créé en 1885

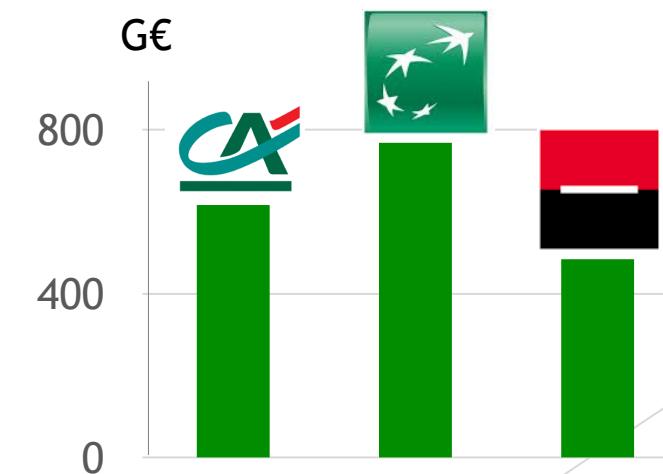
140 000 salariés

30 Mrd € de Produit Net Bancaire annuel



Créé en 2004 sous le nom de CALYON

13 000 salariés





FIN

- Direction financière
- Mesurer et analyser l'activité et l'efficience de l'entreprise
- Fournir des méthodes et outils de pour atteindre les objectifs



ALM/CPM

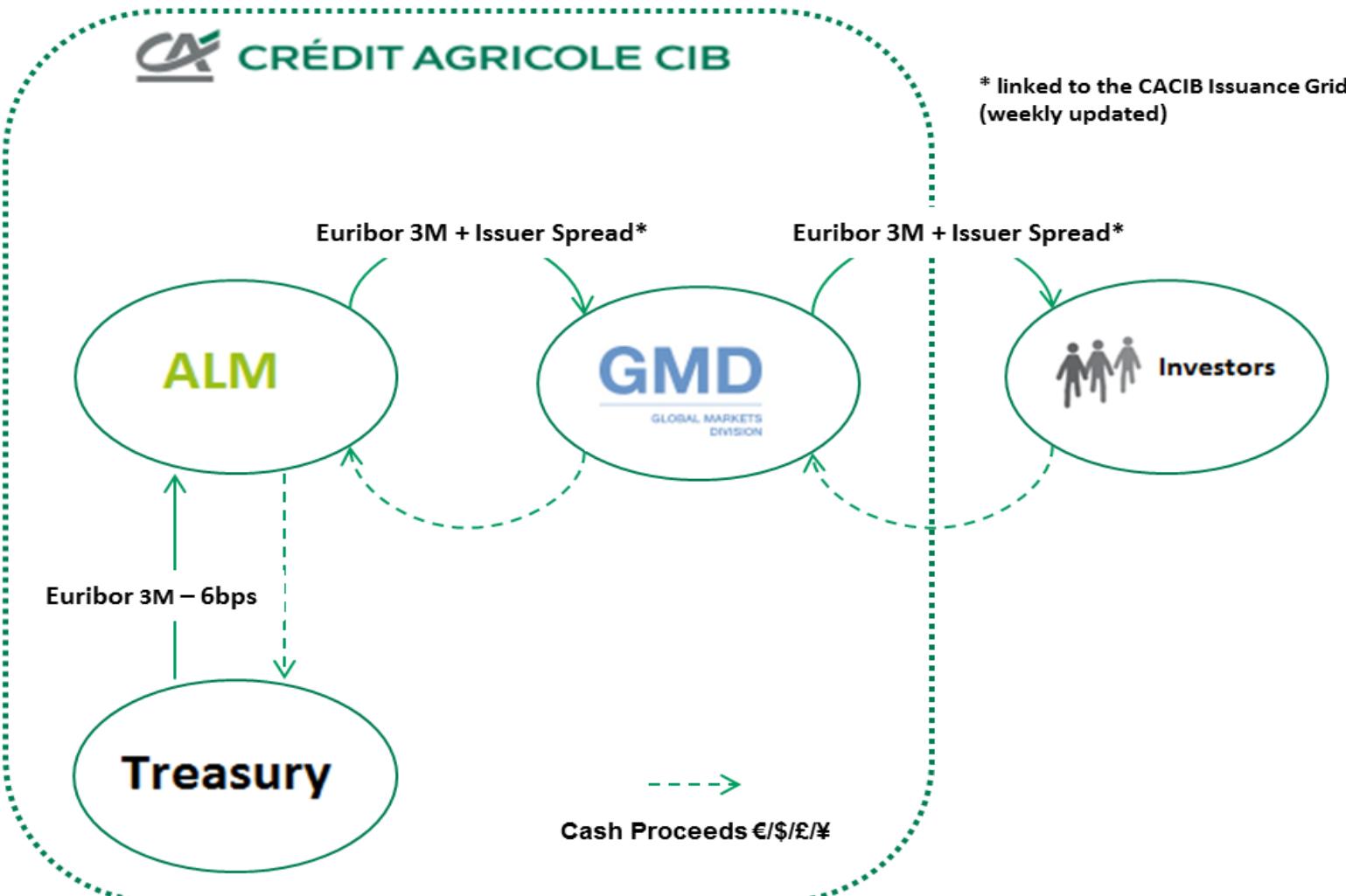
- Asset and Liability Management = Gestion actif-passif
- Prévision et Surveillance des ratios prudentiels de solvabilité et de liquidité



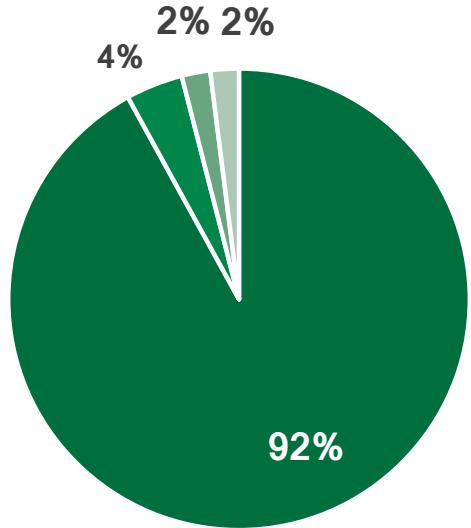
ALM Ops

- Mandats :
 - Dette
 - Facturation
 - Rémunération
 - Collat

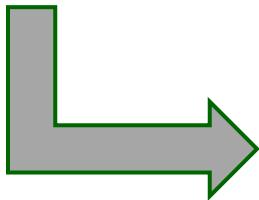
Dette



Système Blofi



- Rates (Taux): C'est un instrument de dette avec options ou un swap.
- FX (Foreign Exchange) : Instrument qui garantira l'investissement en fonction des mouvements d'une ou plusieurs devises.
- Equity Indice Stock (EIS) : instrument de dette où le paiement final basé sur le rendement de l'equity sous-jacent (action(s) ou un indice boursier).
- Hybrids



Search Site = EMEA AND Portfolio IN (K4) AND Mode IN (U) AND Status IN (PendingForSignature)

Blotter Results 17/08/2017 - 01:43 PM

Drag a column and drop it here to group by that column

	Portfolio	MM Type	Direction	Ext sy...	Ext Reference Id	Blofi Id	Front Id	Counterparty sho...	Sta...	Action detailed	Capture date	...
	K4	Loan/Dep...	Borrow	ESPM	AC1939	5797394		CV1_00		Creation	17/08/2017 12:58	1
	K4	Loan/Dep...	Borrow	ESPM	AC1935	5797453		CVZ_00		Creation	17/08/2017 13:17	1
	K4	Loan/Dep...	Borrow	ESPM	AC0608	5797464	3324166	CFSFRPP2PAR		Partial Termin...	26/09/2016 10:14	2

Pricer

1

Funding Spot

Par Dates | Par Duration |

Date de départ : 12/05/2017

Date de maturité : 30/06/2022

Date de la grille : 17/08/2017

Montant : 1 300 000,00

Devise : EUR

Prix Spot: Calcul auto

Calculer un prix avec décote

Retour Calculer

Clear

Obligatoire

CA
CIB

Choix du type d'opération

1 Définir un prix

2 Calculer un BuyBack

Décote CLN

Go

2

Pricing RA

Paramètres

Calculer un Callable/CLN

Date de remboursement (jj/mm/aaaa) : 12/05/2017

Date de maturité (jj/mm/aaaa) : 12/05/2026

Inputs :

Automatiques :

Date de la grille (jj/mm/aaaa) : 17/08/2017

Grille actuelle (valeur auto par défaut): 59,00 bps

Grille initiale : 96,00 bps

Spread bid/offer (valeur auto par défaut) : 10 bps

Profil : Bullet

Montant : 15 000 000,00

Devise : EUR

Notionnel > 5M

Coût théorique de rachat

VAN (même sens que Blofi) : -367 318,63

VAN en % du nominal : 2,45

ALM paye

Information

Trade Date : 12/05/2017

Duration : 9,00

BB Amount : 15000000 EUR

BB Level : 69

Funding Level : 96

$15000000 * 9,00 * (69 - 96) \% = -367 318,63$

Afficher le Coût du call pour l'ALM

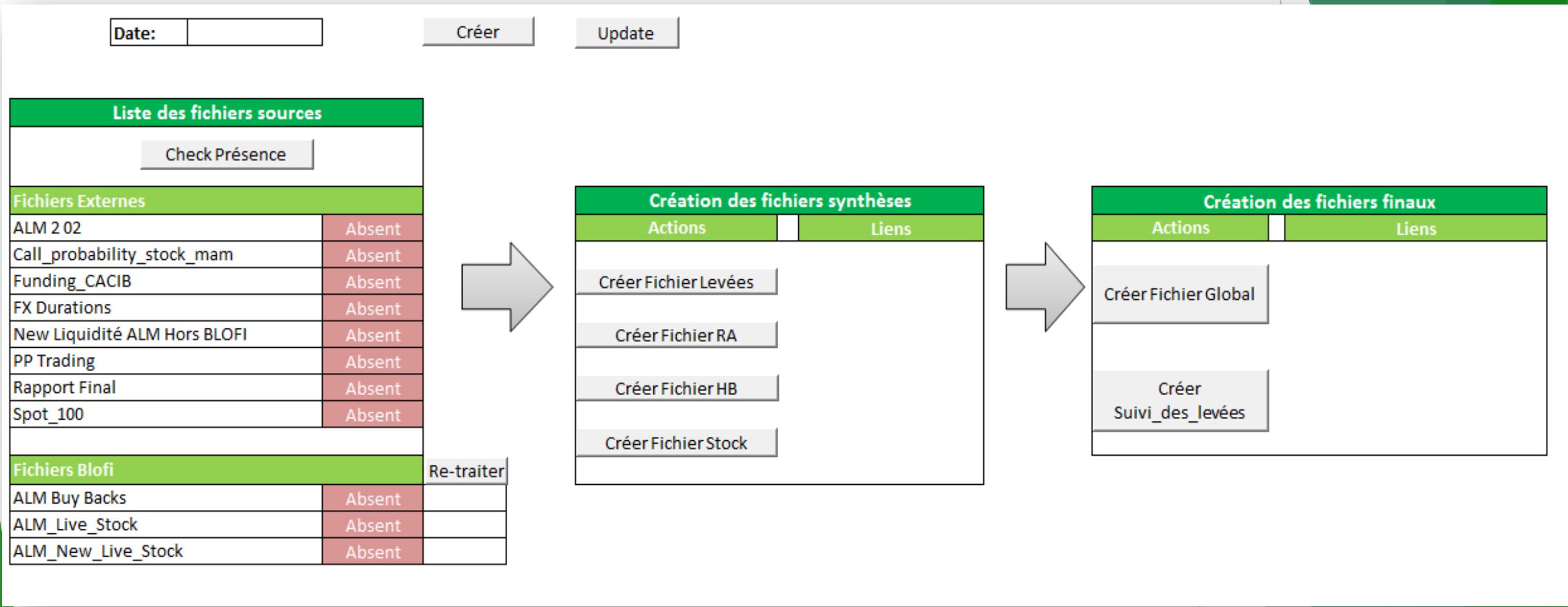
Retour Calcul

Enregistrer

Obligatoire Calcul auto

CA CRÉDIT AGRICOLE CIB

Suivi des levées

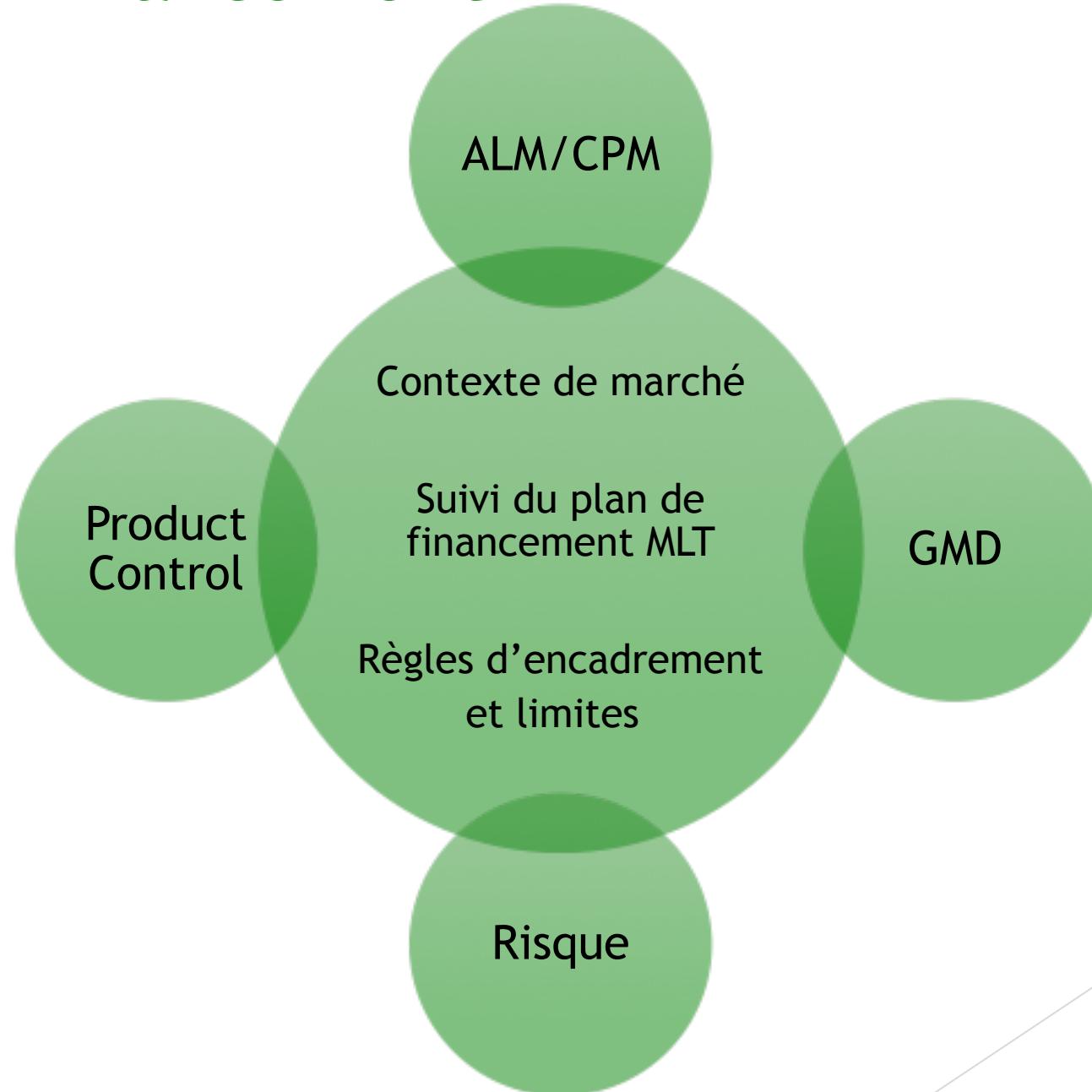


Suivi des levées

27/07/2017

2017 Funding Plan																
<i>In €M</i>	January	February	March	Q1	April	May	June	Q2	July	YTD	YTD Budget	Gap	%	Global Budget		
Senior Unsecured Debt	822	633	409	1 865	250	245	260	754	449	3 068	4 557	-1 489	67%	7 300		
O/w USD	870	332	401	1 004	122	224	94	440	190	2 240	2 497	-257	00%	4 000		
EMTN	822	505	408	1 735	250	245	214	709	449	2 893	3 745	-853	77%	6 000		
O/w USD	870	332	401	1 004	122	224	94	440	190	2 240	2 497	-257	00%	4 000		
Gross	955	632	607	2 195	355	454	431	1 239	516	3 950	5 306	-1 356	74%	8 500		
O/w USD	884	349	434	1 007	152	242	178	572	225	2 404	3 537	-1 074	70%	5 007		
O/w JPY	0	0	0	-	-	19	89	108	5	113	0	113	-	0		
O/w GBP	2	0	0	2	3	19	2	24	-	20	0	26	-	0		
O/w AUD	0	0	0	-	-	1	-	1	-	1	0	1	-	0		
Early Redemption	-133	-128	-200	-	460	-105	-	208	-	530	-67	-1 561	503	68%	-2 500	
O/w USD	-14	-17	-32	-	63	-20	-	18	-	84	-132	-224	-1 040	817	22%	-1 007
Non-Preferred	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	1 300		
CASA Unsecured	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
Other	-	128	2	130	-	-	45	46	-	176	0	176	-	0		
Subordinated Debt	0	0	0	-	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0		
O/w USD	0	0	0	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
ATier1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
O/w USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
Tier2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
O/w USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
Others	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
Senior Debt Secured	0	0	0	-	500	-	-	500	500	1 000	0	1 000	0	750		
O/w USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
TLTRO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0	-	0		
SCF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	500	0	500	-	750		
Others	-	-	-	-	500	-	-	500	-	500	0	500	-	0		
Total	822	633	409	1 865	750	245	260	1 254	949	4 068	4 557	-489	89%	8 050		
O/w USD	870	332	401	1 604	122	224	94	440	196	2 240	2 497	-257	00%	4 000		
Securitization Hedging	1 158	0	0	1 158	-	-	376	376	-	1 534	1 500	34	102%	1 500		
O/w USD	1 158	0	0	1 158	-	-	376	376	-	1 534	1 500	34	102%	1 500		

Comité de financement



Rémunération



Testeur d'Add-on

Term deposits raised by treasury			
Eligibility per Currency / Booking entity			
Major currencies	"Local" currencies	Other currencies/entities	
<i>In all booking areas</i> EUR (+SEK, DKK, PLN, NOK, CZK), USD (+CAD), HKD, SGD, AUD, GBP, JPY*	CNY/China RUB/ Russia TWD/Taiwan		
MLT stability add-on			PRS price = 7 bps**

	Client type	Maturity <=367d		Maturity <=548d
		Multiproduct client	Monoprod uct client	
General rules	Corporate	7 bps	7 bps	4 bps
	SAS	7 bps	7 bps	
Booking MENA area	Corporate	14 bps	7 bps	
	SAS	7 bps	7 bps	
Booking ASIA area				

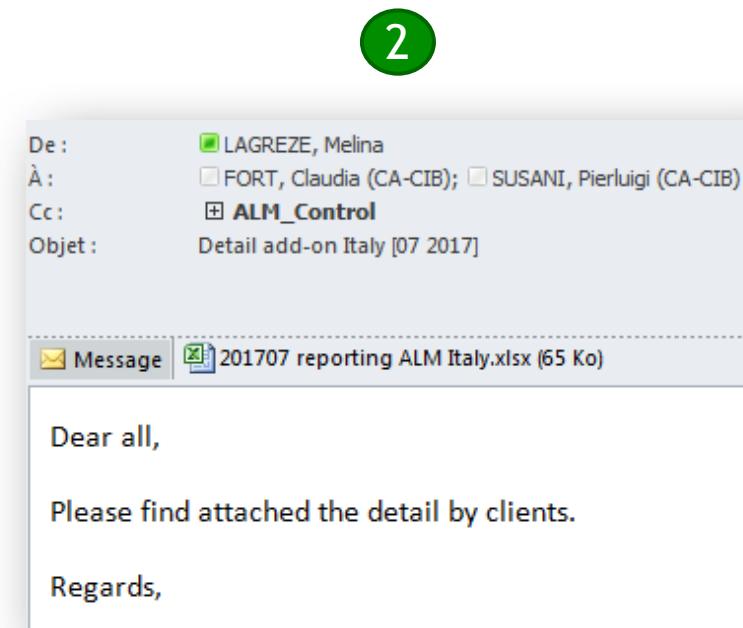
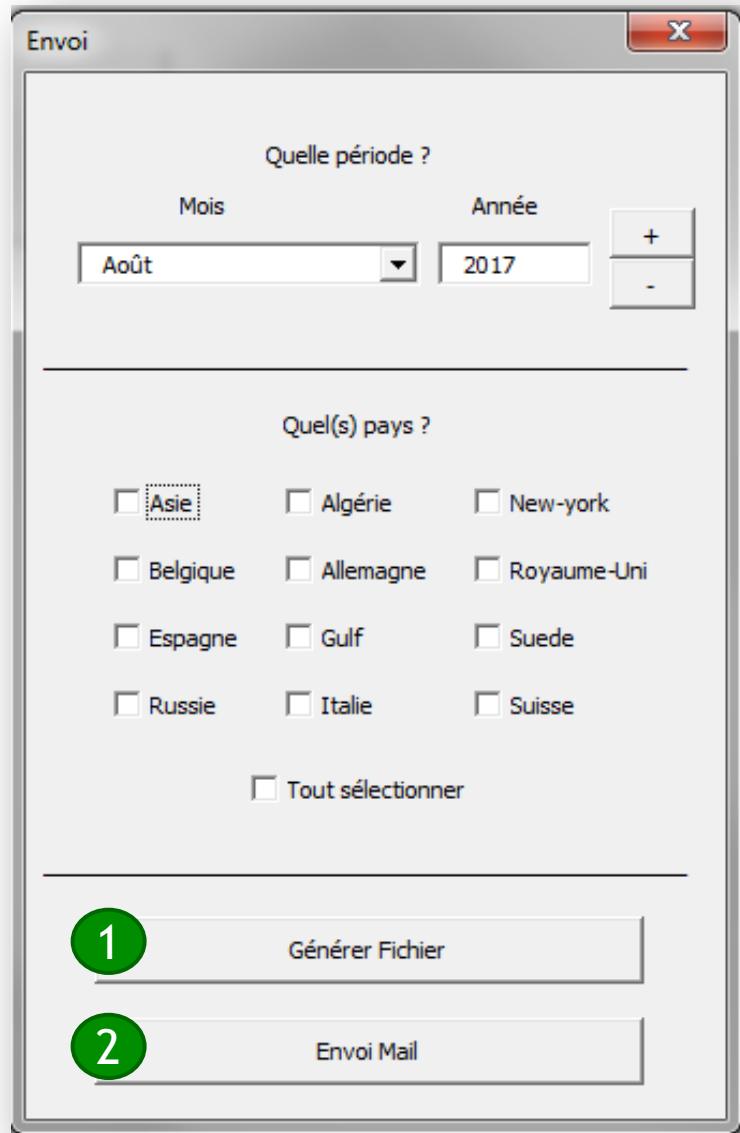
Cf. corresponding spreadsheet

Scheme applicable up to 250m€ (maturity<6M) or 500m€ (maturity between 6M and 18M), per RICOS counterpart
For MENA booking zone, scheme applicable up to 200m€ per RICOS counterpart + global limit of 1.6G€ on total deposit amounts

Term deposits raised by treasury				
Eligibility per Currency / Booking entity				
Major currencies	"Local" currencies	Other currencies/entities		
<i>In all booking areas</i> EUR (+SEK, DKK, PLN, NOK, CZK), USD (+CAD), HKD, SGD, AUD, GBP, JPY	CNY/China RUB/ Russia TWD/Taiwan			
MLT stability add-on			7	
	Client type	Maturity <=367d		Maturity <=548d
		Multiproduct client	Monoprodu ct client	
General rules	Corporate	7	7	4
	SAS	7	7	
Booking MENA area	Corporate	14	7	
	SAS	7	7	
Booking ASIA area				

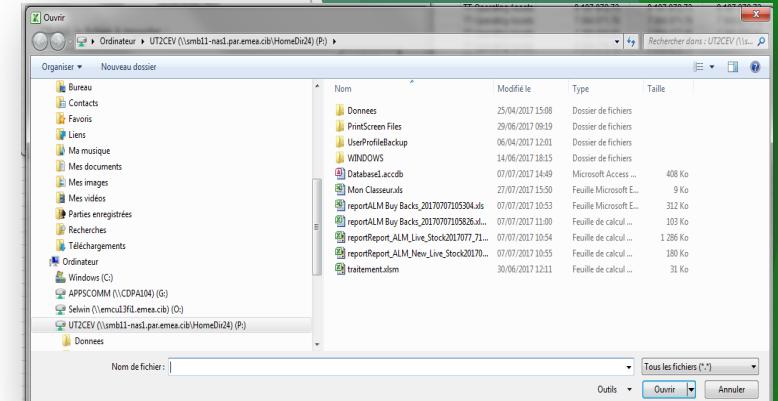
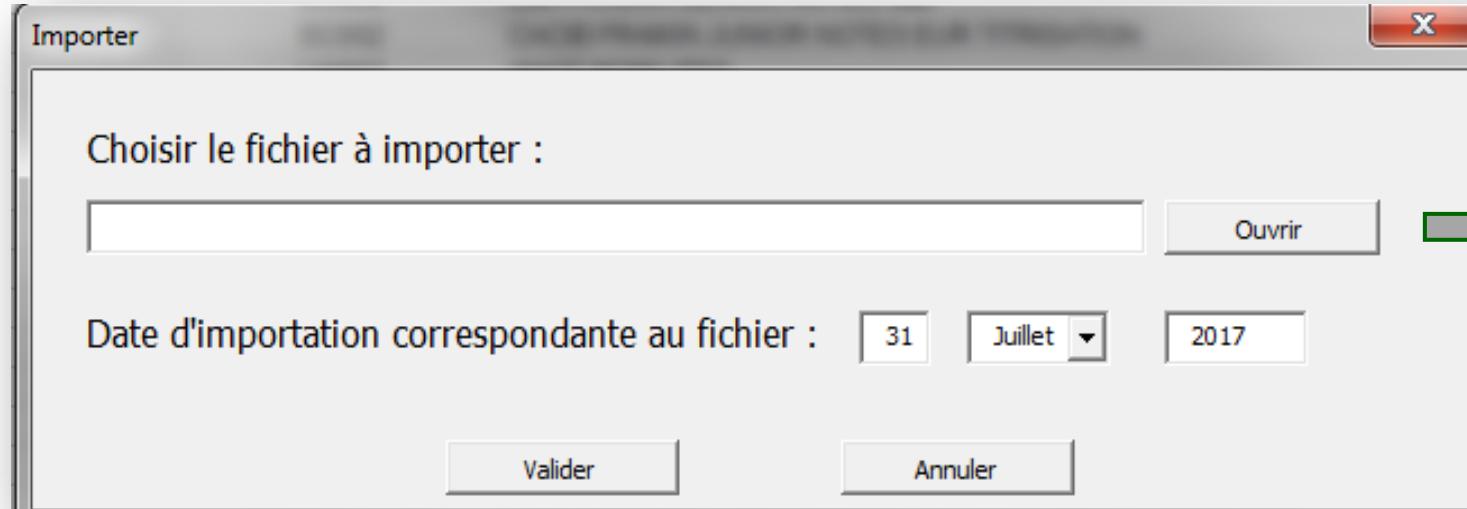
Scheme applicable up to 250m€ (maturity<6M) or 500m€ (maturity between 6M and 18M), per RICOS counterpart
For MENA booking zone, scheme applicable up to 200m€ per RICOS counterpart + global limit of 1.6G€ on total deposit amounts

Reporting d'Add-on



Facturation

Titrisation



Assiette de facturation en Euro	Ref ALM	Date Début	Date maturité de référence	Maturité exacte	interpo	Formule applicable N	Coefficient	LCF	Assiette	Assiette finale	Cout recalculé	Pour reporting : Coût PU	besoins reporting : Facturation PU MLT	besoin reporting : Assiette PNU	Représente Cliq?	Coût présent Cliq	Coût non présent cliq	PU<1an

Cliq III

Conclusion

Département
transverse

Formation
métier

Consolidation
technique

Expériences

Merci pour votre attention