

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Juillet 2017**



AGENCE
FRANCE TRÉSOR

► **Adjudications moyen et long terme**

| Type d'obligation | Taux du coupon | Date de jouissance | Date d'adjudication | Montant émis (en M d'euros) | Date de règlement | Date d'échéance | Prix moyen pondéré | Coefficient d'indexation |
|-------------------|----------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------|
| OAT | 1,00% | 25/05/2017 | 06/07/2017 | 3 789 | 10/07/2017 | 25/05/2027 | 101,68% | - |
| OAT | 2,75% | 25/10/2016 | 06/07/2017 | 2 425 | 10/07/2017 | 25/10/2027 | 118,60% | - |
| OAT | 2,00% | 25/05/2017 | 06/07/2017 | 2 285 | 10/07/2017 | 25/05/2048 | 103,01% | - |
| OAT | 0,00% | 25/02/2017 | 20/07/2017 | 4 039 | 24/07/2017 | 25/02/2020 | 101,07% | - |
| OAT | 0,00% | 25/05/2017 | 20/07/2017 | 3 691 | 24/07/2017 | 25/05/2022 | 100,20% | - |
| OAT | 2,25% | 25/10/2016 | 20/07/2017 | 1 473 | 24/07/2017 | 25/10/2022 | 111,79% | - |
| OAT€i | 1,85% | 25/07/2016 | 20/07/2017 | 1 328 | 24/07/2017 | 25/07/2027 | 123,67% | 1,086900 |
| OATi | 0,10% | 01/03/2017 | 20/07/2017 | 497 | 24/07/2017 | 01/03/2028 | 104,66% | 1,012270 |
| OAT€i | 0,10% | 25/07/2016 | 20/07/2017 | 346 | 24/07/2017 | 25/07/2047 | 99,49% | 1,041770 |
| TOTAL OAT | | | | 19 873 | | | | |

► **Adjudications court terme**

| Type d'obligation | Date d'adjudication | Durée (en semaines) | Montant émis (en M d'euros) | Date de règlement | Date d'échéance | Taux moyen pondéré (%) |
|-------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| BTF | 03/07/2017 | 13 | 3 586 | 05/07/2017 | 04/10/2017 | -0,618% |
| BTF | 03/07/2017 | 20 | 1 637 | 05/07/2017 | 22/11/2017 | -0,604% |
| BTF | 03/07/2017 | 50 | 1 484 | 05/07/2017 | 20/06/2018 | -0,562% |
| BTF | 10/07/2017 | 12 | 3 194 | 12/07/2017 | 04/10/2017 | -0,593% |
| BTF | 10/07/2017 | 23 | 1 567 | 12/07/2017 | 20/12/2017 | -0,551% |
| BTF | 10/07/2017 | 49 | 1 255 | 12/07/2017 | 20/06/2018 | -0,550% |
| BTF | 17/07/2017 | 13 | 3 748 | 19/07/2017 | 18/10/2017 | -0,576% |
| BTF | 17/07/2017 | 22 | 1 503 | 19/07/2017 | 20/12/2017 | -0,536% |
| BTF | 17/07/2017 | 48 | 1 264 | 19/07/2017 | 20/06/2018 | -0,542% |
| BTF | 24/07/2017 | 12 | 3 679 | 26/07/2017 | 18/10/2017 | -0,592% |
| BTF | 24/07/2017 | 21 | 1 652 | 26/07/2017 | 20/12/2017 | -0,536% |
| BTF | 24/07/2017 | 47 | 1 494 | 26/07/2017 | 20/06/2018 | -0,536% |
| BTF | 31/07/2017 | 13 | 3 669 | 02/08/2017 | 01/11/2017 | -0,593% |
| BTF | 31/07/2017 | 20 | 1 417 | 02/08/2017 | 20/12/2017 | -0,584% |
| BTF | 31/07/2017 | 50 | 1 510 | 02/08/2017 | 18/07/2018 | -0,546% |
| TOTAL BTF | | | 32 659 | | | |

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État :

0 €



AGENCE
FRANCE TRÉSOR

► **Pensions livrées**

| Encours des pensions livrées | Fin de mois | Moyenne du mois |
|------------------------------|-------------|-----------------|
| Prises en pensions | - | - |
| Mises en pensions | - | - |

► **Dépôts et emprunts**

| Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des États de cette même zone et des agences supranationales | Fin de mois | Moyenne du mois |
|--|-------------------|-------------------|
| Dépôts | 11 900 000 000,00 | 10 119 354 838,71 |
| Emprunts | - | - |

► **Billets de trésorerie**

| Encours des billets de trésorerie | Fin de mois | Moyenne du mois |
|--|-------------|-----------------|
| Billets de trésorerie émis par l'ACOSS | - | 96 774 193,55 |

► **Contrats d'échange de taux d'intérêts**

Volume nominal négocié au cours du mois :

0 €

► **Durée de vie moyenne de la dette négociable incluant les opérations d'échange de taux d'intérêt**

Au 31 juillet 2017 : 7 ans et 271 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er juillet 2017**

Aux OATi : 101,23 (base 2015)

Aux OAT€i : 101,96 (base 2015)