



Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) février 2020

► 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	0,00 %	25 novembre 2019	6 février 2020	5944	10 février 2020	25 novembre 2029	101,03 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2019	6 février 2020	2043	10 février 2020	25 mai 2034	115,46 %	-
OAT	1,75 %	25 juin 2019	6 février 2020	1982	10 février 2020	25 juin 2039	125,57 %	-
OAT	1,75 %	25 mai 2019	6 février 2020	1285	10 février 2020	25 mai 2066	135,10 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2019	20 février 2020	3424	24 février 2020	25 février 2023	101,80 %	-
OAT	0,00 %	25 mars 2019	20 février 2020	3202	24 février 2020	25 mars 2025	102,58 %	-
OAT	0,25 %	25 novembre 2019	20 février 2020	3751	24 février 2020	25 novembre 2026	104,44 %	-
OATi	0,10 %	1 mars 2019	20 février 2020	583	24 février 2020	1 mars 2025	106,57 %	1,044250
OATei	0,10 %	1 mars 2019	20 février 2020	645	24 février 2020	1 mars 2029	112,51 %	1,009220
OATei	0,10 %	25 juillet 2019	20 février 2020	603	24 février 2020	25 juillet 2036	119,15 %	1,031340
TOTAL OAT				23 462				

► 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	03/02/20	12	2 521	05/02/20	29/04/20	-0,596 %
BTF	03/02/20	21	1 007	05/02/20	01/07/20	-0,595 %
BTF	03/02/20	51	1 097	05/02/20	27/01/21	-0,596 %
BTF	10/02/20	13	2 695	12/02/20	13/05/20	-0,609 %
BTF	10/02/20	20	1 018	12/02/20	01/07/20	-0,592 %
BTF	10/02/20	50	838	12/02/20	27/01/21	-0,586 %
BTF	17/02/20	12	2 400	19/02/20	13/05/20	-0,596 %
BTF	17/02/20	23	1 096	19/02/20	29/07/20	-0,587 %
BTF	17/02/20	49	894	19/02/20	27/01/21	-0,582 %
BTF	24/02/20	13	2 257	26/02/20	27/05/20	-0,587 %
BTF	24/02/20	22	798	26/02/20	29/07/20	-0,589 %
BTF	24/02/20	32	398	26/02/20	07/10/20	-0,598 %
BTF	24/02/20	48	795	26/02/20	27/01/21	-0,591 %
TOTAL BTF			17 814			



► **Rachats de gré à gré :**

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

2 300 000 000 €

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2021	1 000 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	100 000 000
OAT 3,25 % 25/10/2021	325 000 000
OAT 3,75 % 25/04/2021	755 000 000
OATi 0,10 % 25/07/2021	120 000 000

► **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	7 300 000 000,00	7 595 172 413,79
Emprunts	-	-

► **Billets de trésorerie**

Encours des billets de trésorerie	Fin de mois	Moyenne du mois
Billets de trésorerie émis par l'ACOSS	-	-

► **Contrats d'opérations d'échange à terme de taux d'intérêts :**

pas d'opération réalisée

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

Au 29 février 2020 : 8 ans et 95 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er février 2020**

Aux OATi : 103,92 (base 2015)

Aux OAT€i : 104,79 (base 2015)