

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Février 2021**

► **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 2020	4 février 2021	6154	8 février 2021	25 novembre 2030	102,49 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2020	4 février 2021	1587	8 février 2021	25 mai 2036	118,28 %	-
OAT	1,75 %	25 juin 2020	4 février 2021	1499	8 février 2021	25 juin 2039	129,29 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	4 février 2021	1756	8 février 2021	25 mai 2052	107,12 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	18 février 2021	4340	22 février 2021	25 février 2024	101,84 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	18 février 2021	2658	22 février 2021	25 février 2026	102,54 %	-
OAT	0,50 %	25 mai 2020	18 février 2021	3040	22 février 2021	25 mai 2029	106,29 %	-
OATi	0,10 %	1 mars 2020	18 février 2021	275	22 février 2021	1 mars 2036	117,49 %	0,996580
OATei	0,10 %	1 mars 2020	18 février 2021	883	22 février 2021	1 mars 2026	108,44 %	0,995080
OATei	0,10 %	25 juillet 2020	18 février 2021	498	22 février 2021	25 juillet 2047	129,19 %	1,042070
TOTAL OAT				22 690				

► **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	01/02/21	12	2 495	03/02/21	28/04/21	-0,631 %
BTF	01/02/21	21	1 425	03/02/21	30/06/21	-0,627 %
BTF	01/02/21	51	1 711	03/02/21	26/01/22	-0,642 %
BTF	08/02/21	13	3 152	10/02/21	12/05/21	-0,643 %
BTF	08/02/21	20	1 196	10/02/21	30/06/21	-0,635 %
BTF	08/02/21	50	1 983	10/02/21	26/01/22	-0,642 %
BTF	15/02/21	12	3 300	17/02/21	12/05/21	-0,642 %
BTF	15/02/21	23	1 396	17/02/21	28/07/21	-0,635 %
BTF	15/02/21	49	1 598	17/02/21	26/01/22	-0,637 %
BTF	22/02/21	13	2 596	24/02/21	27/05/21	-0,617 %
BTF	22/02/21	22	1 400	24/02/21	28/07/21	-0,616 %
BTF	22/02/21	40	485	24/02/21	01/12/21	-0,622 %
BTF	22/02/21	48	1 392	24/02/21	26/01/22	-0,614 %
TOTAL BTF			24 129			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **1 425 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/02/2022	1 425 000 000

► **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 Etats de cette même zone	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	4 500 000 000,00	3 839 285 714,29
Emprunts	-	-

Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des agences supranationales	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	0,00	0,00
Emprunts	-	-

► **Billets de trésorerie**

Encours des billets de trésorerie	Fin de mois	Moyenne du mois
Billets de trésorerie émis par l'ACOSS	0,00	0,00

► Contrats d'opérations d'échange à terme de devise :

Date d'échéance	Devise	Montant acheté en devise	Montant vendu en EUR	Taux de change à terme
06/04/2022	USD	35 000 000,00	28 536 485,94	1,22650
05/04/2023	USD	35 000 000,00	28 297 691,72	1,23685
03/04/2024	USD	36 000 000,00	28 765 481,42	1,25150

► Contrats d'opération de couverture pétrole :

pas d'opération réalisée

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

Au 28 février 2021 : 8 ans et 136 jours

► Références d'inflation applicables au 1er février 2021

Aux OATi : 103,86 (base 2015)

Aux OAT€i : 104,35 (base 2015)