

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)  
Mars 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 mars 2021	6 272	8 mars 2021	25 novembre 2030	100,70 %	
OAT	0,50 %	25 mai 2020	4 mars 2021	2 344	8 mars 2021	25 mai 2040	101,25 %	
OAT	0,75 %	25 mai 2020	4 mars 2021	2 383	8 mars 2021	25 mai 2052	100,74 %	
OAT	0,00 %	25 février 2021	18 mars 2021	6 028	22 mars 2021	25 février 2024	101,82 %	
OAT	0,00 %	25 février 2021	18 mars 2021	3 949	22 mars 2021	25 février 2026	102,39 %	
OAT	0,75 %	25 mai 2020	18 mars 2021	1 793	22 mars 2021	25 mai 2028	107,50 %	
OATi	0,10 %	1 mars 2021	18 mars 2021	360	22 mars 2021	1 mars 2028	110,25 %	1,041500
OATei	0,10 %	1 mars 2021	18 mars 2021	1 028	22 mars 2021	1 mars 2026	109,37 %	0,997070
OATei	0,70 %	25 juillet 2020	18 mars 2021	609	22 mars 2021	25 juillet 2030	121,28 %	1,049110
<b>TOTAL OAT</b>				<b>24 766</b>				

► **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	01/03/21	12	3 122	03/03/21	27/05/21	-0,605 %
BTF	01/03/21	21	1 778	03/03/21	28/07/21	-0,603 %
BTF	01/03/21	35	583	03/03/21	04/11/21	-0,605 %
BTF	01/03/21	51	1 681	03/03/21	23/02/22	-0,590 %
BTF	08/03/21	13	3 293	10/03/21	09/06/21	-0,621 %
BTF	08/03/21	20	1 494	10/03/21	28/07/21	-0,619 %
BTF	08/03/21	50	1 395	10/03/21	23/02/22	-0,610 %
BTF	15/03/21	12	2 797	17/03/21	09/06/21	-0,607 %
BTF	15/03/21	23	1 536	17/03/21	25/08/21	-0,604 %
BTF	15/03/21	39	497	17/03/21	15/12/21	-0,606 %
BTF	15/03/21	49	1 625	17/03/21	23/02/22	-0,605 %
BTF	22/03/21	13	2 635	24/03/21	23/06/21	-0,619 %
BTF	22/03/21	22	1 318	24/03/21	25/08/21	-0,620 %
BTF	22/03/21	28	514	24/03/21	06/10/21	-0,615 %
BTF	22/03/21	48	1 927	24/03/21	23/02/22	-0,625 %
BTF	29/03/21	12	2 497	31/03/21	23/06/21	-0,629 %
BTF	29/03/21	21	1 495	31/03/21	25/08/21	-0,627 %
BTF	29/03/21	51	1 987	31/03/21	23/03/22	-0,630 %
<b>TOTAL BTF</b>			<b>32 174</b>			

► **Rachats de gré à gré :**

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

2 500 000 000 €

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/02/2022	2 105 000 000
OAT 0,00% 25/05/2022	20 000 000
OAT 2,25% 25/10/2022	150 000 000
OAT 3,00% 25/04/2022	150 000 000
OAT 8,25% 25/04/2022	75 000 000

► **OAT syndication**

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date de syndication	Montant émis (en M d'euros)	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
OAT	0,50 %	25 juin 2020	16 mars 2021	7 000	23 mars 2021	25 juin 2044	99,43 %	

► **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	Fin de mois	Moyenne du mois

Dépôts	5 400 000 000,00	5 848 387 096,77
Emprunts	-	-

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

► **Billets de trésorerie**

Encours des billets de trésorerie	<b>Fin de mois</b>	<b>Moyenne du mois</b>
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
24/03/2021	USD	52 349 800,00	43 777 836,87	1,195806

► **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 31 mars 2021 : 8 ans et 135 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er mars 2021**

Aux OATI : 104,09 (base 2015)

Aux OATéi : 104,70 (base 2015)