

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) mai 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	0,75 %	25 mai 2019	7 mai 2020	4401	11 mai 2020	25 mai 2028	106,84 %	-
OAT	0,00 %	25 novembre 2019	7 mai 2020	6351	11 mai 2020	25 novembre 2029	99,75 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2019	7 mai 2020	1810	11 mai 2020	25 mai 2052	98,08 %	-
OAT	4,00 %	25 avril 2060	7 mai 2020	1292	11 mai 2020	25 avril 2060	205,96 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	20 mai 2020	3044	25 mai 2020	25 février 2023	101,41 %	-
OAT	1,75 %	25 mai 2020	20 mai 2020	2214	25 mai 2020	25 mai 2023	106,92 %	-
OAT	1,00 %	25 novembre 2019	20 mai 2020	2673	25 mai 2020	25 novembre 2025	107,39 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	20 mai 2020	4530	25 mai 2020	25 février 2026	101,60 %	-
OATi	0,10 %	25 mai 2020	20 mai 2020	260	25 mai 2020	1 mars 2025	102,69 %	1,040000
OATei	0,70 %	25 juillet 2019	20 mai 2020	968	25 mai 2020	25 juillet 2030	113,38 %	1,047370
OATei	0,10 %	25 juillet 2019	20 mai 2020	337	25 mai 2020	25 juillet 2036	108,17 %	1,027300
TOTAL OAT				27 880				

► **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	04/05/20	13	5 196	06/05/20	05/08/20	-0,475 %
BTF	04/05/20	20	2 848	06/05/20	23/09/20	-0,455 %
BTF	04/05/20	46	1 219	06/05/20	24/03/21	-0,477 %
BTF	04/05/20	50	2 473	06/05/20	21/04/21	-0,462 %
BTF	11/05/20	12	4 126	13/05/20	05/08/20	-0,549 %
BTF	11/05/20	21	1 153	13/05/20	07/10/20	-0,516 %
BTF	11/05/20	23	2 067	13/05/20	21/10/20	-0,505 %
BTF	11/05/20	49	2 524	13/05/20	21/04/21	-0,496 %
BTF	18/05/20	13	4 096	20/05/20	19/08/20	-0,551 %
BTF	18/05/20	22	1 996	20/05/20	21/10/20	-0,519 %
BTF	18/05/20	28	1 101	20/05/20	02/12/20	-0,516 %
BTF	18/05/20	48	2 914	20/05/20	21/04/21	-0,498 %
BTF	25/05/20	12	3 998	27/05/20	19/08/20	-0,526 %
BTF	25/05/20	15	997	27/05/20	09/09/20	-0,564 %
BTF	25/05/20	21	2 194	27/05/20	21/10/20	-0,519 %
BTF	25/05/20	51	2 794	27/05/20	19/05/21	-0,517 %
TOTAL BTF			41 696			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : pas d'opération réalisée

► **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	8 700 000 000,00	7 629 032 258,06
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	3 000 000 000,00	3 000 000 000,00
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 taux d'intérêts :**

Date d'échéance	Montant acheté en USD	Montant vendu en EUR	Taux de Change à terme
16/06/2020	56 831 148,50	52 312 643,88	1,086375

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

Au 30 mai 2020 : 8 ans et 20 jours

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

Aux OATi : 103,93000 (base 2015)

Aux OAT€i : 104,23000 (base 2015)