

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Mai 2022**

► **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 mai 2021	5 mai 2022	6 279	9 mai 2022	25 mai 2032	86,03 %	
OAT	0,50 %	25 mai 2021	5 mai 2022	2 268	9 mai 2022	25 mai 2040	79,66 %	
OAT	0,75 %	25 mai 2021	5 mai 2022	2 452	9 mai 2022	25 mai 2053	71,97 %	
OAT	0,00 %	25 février 2022	19 mai 2022	4 222	23 mai 2022	25 février 2025	98,27 %	
OAT	0,00 %	25 février 2022	19 mai 2022	4 194	23 mai 2022	25 février 2026	97,16 %	
OAT	0,75 %	25 février 2022	19 mai 2022	5 778	23 mai 2022	25 février 2028	98,25 %	
OATei	0,10 %	25 juillet 2021	19 mai 2022	738	23 mai 2022	25 juillet 2031	112,48 %	1,079540
OATi	0,10 %	1 mars 2022	19 mai 2022	564	23 mai 2022	1 mars 2032	112,55 %	1,049540
OATi	0,10 %	1 mars 2022	19 mai 2022	232	23 mai 2022	1 mars 2036	113,91 %	1,046530
TOTAL OAT				26 727				

► **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	2 mai 2022	13	3 193	04/05/22	03/08/22	-0,652 %
BTF	2 mai 2022	20	909	04/05/22	21/09/22	-0,547 %
BTF	2 mai 2022	26	399	04/05/22	02/11/22	-0,519 %
BTF	2 mai 2022	50	1 198	04/05/22	19/04/23	-0,167 %
BTF	9 mai 2022	12	2 995	11/05/22	03/08/22	-0,631 %
BTF	9 mai 2022	23	1 470	11/05/22	19/10/22	-0,477 %
BTF	9 mai 2022	45	562	11/05/22	22/03/23	-0,205 %
BTF	9 mai 2022	49	1 011	11/05/22	19/04/23	-0,120 %
BTF	16 mai 2022	13	2 994	18/05/22	17/08/22	-0,628 %
BTF	16 mai 2022	22	1 397	18/05/22	19/10/22	-0,471 %
BTF	16 mai 2022	48	1 200	18/05/22	19/04/23	-0,147 %
BTF	23 mai 2022	12	3 543	25/05/22	17/08/22	-0,603 %
BTF	23 mai 2022	21	1 392	25/05/22	19/10/22	-0,400 %
BTF	23 mai 2022	51	1 007	25/05/22	17/05/23	0,051 %
BTF	30 mai 2022	13	3 194	01/06/22	31/08/22	-0,561 %
BTF	30 mai 2022	20	1 398	01/06/22	19/10/22	-0,432 %
BTF	30 mai 2022	50	998	01/06/22	17/05/23	0,092 %
TOTAL BTF			28 860			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **2 000 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/03/2023	30 000 000
OAT 1,75% 25/05/2023	1 970 000 000

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
TOTAL OAT				0				

► **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	7 700 000 000	7 370 967 742
Emprunts	0,00	0,00

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	0,00	0,00

► **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
23/06/2022	USD	56 831 148,50	54 682 140,38	1,03930
10/02/2023	USD	135 600 000,00	124 415 083,95	1,08990
31/03/2023	CHF	37 600 000,00	36 550 986,68	1,02870
31/03/2023	USD	21 300 000	19 478 025,50	1,09354
31/03/2023	USD	20 000 000	18 313 508,96	1,09209
31/08/2023	USD	297 200 000,00	269 532 489,91	1,10265
31/10/2023	USD	11 900 000,00	10 759 250,47	1,10603

► **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 mai 2022 : 8 ans et 213 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er mai 2022**

Aux OATi : 108,14 (base 2015)

Aux OATéi : 111,35 (base 2015)