

### Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Juin 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	2,50 %	25 mai 2020	4 juin 2020	3718	8 juin 2020	25 mai 2030	124,65 %	-
OAT	0,00 %	25 novembre 2019	4 juin 2020	5095	8 juin 2020	25 novembre 2030	99,22 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	4 juin 2020	2185	8 juin 2020	25 mai 2052	98,89 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	18 juin 2020	2304	22 juin 2020	25 février 2023	101,51 %	-
OAT	0,00 %	25 mars 2020	18 juin 2020	3851	22 juin 2020	25 mars 2025	102,33 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	18 juin 2020	4094	22 juin 2020	25 février 2026	102,28 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	18 juin 2020	3390	22 juin 2020	25 mai 2028	107,97 %	-
OAT€i	0,10 %	1 mars 2020	18 juin 2020	3044	22 juin 2020	1 mars 2026	105,27 %	0,998510
<b>TOTAL OAT</b>				<b>27 681</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	02/06/20	13	3 891	04/06/20	02/09/20	-0,520 %
BTF	02/06/20	20	2 500	04/06/20	21/10/20	-0,513 %
BTF	02/06/20	38	996	04/06/20	24/02/21	-0,522 %
BTF	02/06/20	50	2 150	04/06/20	19/05/21	-0,514 %
BTF	08/06/20	12	3 600	10/06/20	02/09/20	-0,514 %
BTF	08/06/20	23	2 337	10/06/20	18/11/20	-0,513 %
BTF	08/06/20	25	1 038	10/06/20	02/12/20	-0,505 %
BTF	08/06/20	49	1 598	10/06/20	19/05/21	-0,488 %
BTF	15/06/20	13	4 015	17/06/20	16/09/20	-0,510 %
BTF	15/06/20	22	2 625	17/06/20	18/11/20	-0,507 %
BTF	15/06/20	32	1 036	17/06/20	27/01/21	-0,515 %
BTF	15/06/20	48	1 787	17/06/20	19/05/21	-0,496 %
BTF	22/06/20	12	3 795	24/06/20	16/09/20	-0,551 %
BTF	22/06/20	21	2 373	24/06/20	18/11/20	-0,529 %
BTF	22/06/20	51	2 732	24/06/20	16/06/21	-0,526 %
BTF	29/06/20	13	3 976	01/07/20	30/09/20	-0,523 %
BTF	29/06/20	20	2 291	01/07/20	18/11/20	-0,531 %
BTF	29/06/20	50	2 243	01/07/20	16/06/21	-0,530 %
<b>TOTAL BTF</b>			<b>44 983</b>			

► Rachats de gré à gré :

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

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2021	660 000 000
OAT 3,25 % 25/10/2021	50 000 000
OAT 3,75 % 25/04/2021	163 000 000
OAT€i 2,25 % 25/07/2020	959 300 000

**► 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 %	25/05/2020	27/05/2020	7 000	03/06/2020	25/05/2040	99,527 %	
<b>TOTAL OAT</b>				<b>7 000</b>				

**► 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	5 300 000 000,00	6 633 333 333,33
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	800 000 000,00
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 :**

pas d'opération

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

Au 30 juin 2020 : 7 ans et 355 jours

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

Aux OATi : 103,85000 (base 2015)

Aux OAT€i : 104,77000 (base 2015)