

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Juillet 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	0,00 %	25 novembre 2019	2 juillet 2020	6682	6 juillet 2020	25 novembre 2030	100,91 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2020	2 juillet 2020	2810	6 juillet 2020	25 mai 2034	115,75 %	-
OAT	1,75 %	25 juin 2020	2 juillet 2020	2109	6 juillet 2020	25 juin 2039	126,52 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	2 juillet 2020	3091	6 juillet 2020	25 mai 2052	103,14 %	-
OAT	0,00 %	25 mars 2020	16 juillet 2020	3118	20 juillet 2020	25 mars 2024	102,15 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	16 juillet 2020	5607	20 juillet 2020	25 février 2026	102,56 %	-
OAT	3,50 %	25 avril 2020	16 juillet 2020	2585	20 juillet 2020	25 avril 2026	123,27 %	-
OAT	2,75 %	25 octobre 2019	16 juillet 2020	2206	20 juillet 2020	25 octobre 2027	123,10 %	-
OATeI	0,10 %	1 mars 2020	16 juillet 2020	550	20 juillet 2020	1 mars 2026	106,24 %	0,998630
OATeI	0,10 %	1 mars 2020	16 juillet 2020	512	20 juillet 2020	1 mars 2029	109,58 %	1,008520
OATeI	0,10 %	25 juillet 2019	16 juillet 2020	192	20 juillet 2020	25 juillet 2047	125,49 %	1,045800
TOTAL OAT				29 462				

► 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	06/07/20	12	3 997	08/07/20	30/09/20	-0,551 %
BTF	06/07/20	23	2 614	08/07/20	16/12/20	-0,557 %
BTF	06/07/20	49	2 357	08/07/20	16/06/21	-0,559 %
BTF	13/07/20	13	3 546	15/07/20	14/10/20	-0,555 %
BTF	13/07/20	22	2 712	15/07/20	16/12/20	-0,552 %
BTF	13/07/20	36	832	15/07/20	24/03/21	-0,560 %
BTF	13/07/20	48	2 131	15/07/20	16/06/21	-0,557 %
BTF	20/07/20	12	3 627	22/07/20	14/10/20	-0,569 %
BTF	20/07/20	21	1 998	22/07/20	16/12/20	-0,566 %
BTF	20/07/20	27	817	22/07/20	27/01/21	-0,576 %
BTF	20/07/20	51	2 494	22/07/20	14/07/21	-0,564 %
BTF	27/07/20	13	3 736	29/07/20	28/10/20	-0,565 %
BTF	27/07/20	20	2 233	29/07/20	16/12/20	-0,562 %
BTF	27/07/20	50	2 101	29/07/20	14/07/21	-0,556 %
TOTAL BTF			35 195			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : 7 202 000 000 €

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2021	5 020 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	657 000 000
OAT 2,25 % 25/10/2022	1 000 000 000
OAT 3,00 % 25/04/2022	200 000 000
OAT 3,25 % 25/10/2021	50 000 000
OAT 3,75 % 25/04/2021	200 000 000
OATEI 2,25 % 25/07/2020	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
OATi	0,10 %	01/03/2020	08/07/2020	3 000	15/07/2020	01/03/2036	112,028 %	0,995050
TOTAL OAT				3 000				

► **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 États de cette même zone	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	7 400 000 000,00	6 903 225 806,45
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 taux d'intérêts :** pas d'opération

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

Au 31 juillet 2020 : 8 ans et 15 jours

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

Aux OATi : 103,81000 (base 2015)

Aux OATÉi : 105,06000 (base 2015)