

### Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Août 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	5,50 %	25 avril 2020	6 août 2020	1938	10 août 2020	25 avril 2029	151,96 %	-
OAT	2,50 %	25 mai 2020	6 août 2020	3873	10 août 2020	25 mai 2030	127,56 %	-
OAT	1,50 %	25 mai 2020	6 août 2020	3159	10 août 2020	25 mai 2031	118,73 %	-
OAT	1,50 %	25 mai 2020	6 août 2020	2238	10 août 2020	25 mai 2050	130,46 %	-
OAT	1,75 %	25 novembre 2019	20 août 2020	1511	24 août 2020	25 novembre 2024	110,13 %	-
OAT	0,00 %	25 mars 2020	20 août 2020	3442	24 août 2020	25 mars 2025	102,65 %	-
OAT	1,00 %	25 mai 2020	20 août 2020	2372	24 août 2020	25 mai 2027	109,94 %	-
OATi	0,10 %	1 mars 2020	20 août 2020	395	24 août 2020	1 mars 2028	108,40 %	1,039750
OATei	3,15 %	25 juillet 2020	20 août 2020	231	24 août 2020	25 juillet 2032	154,49 %	1,298150
OATei	0,10 %	25 juillet 2020	20 août 2020	330	24 août 2020	25 juillet 2036	118,95 %	1,032710
<b>TOTAL OAT</b>				<b>19 489</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	03/08/20	12	3 398	05/08/20	28/10/20	-0,574 %
BTF	03/08/20	23	2 496	05/08/20	13/01/21	-0,590 %
BTF	03/08/20	49	1 610	05/08/20	14/07/21	-0,560 %
BTF	10/08/20	13	2 660	12/08/20	11/11/20	-0,576 %
BTF	10/08/20	22	2 897	12/08/20	13/01/21	-0,631 %
BTF	10/08/20	48	1 244	12/08/20	14/07/21	-0,565 %
BTF	17/08/20	12	2 694	19/08/20	11/11/20	-0,571 %
BTF	17/08/20	21	1 430	19/08/20	13/01/21	-0,602 %
BTF	17/08/20	27	540	19/08/20	24/02/21	-0,605 %
BTF	17/08/20	51	1 503	19/08/20	11/08/21	-0,571 %
BTF	24/08/20	13	2 395	26/08/20	25/11/20	-0,568 %
BTF	24/08/20	20	1 197	26/08/20	13/01/21	-0,606 %
BTF	24/08/20	50	1 797	26/08/20	11/08/21	-0,578 %
BTF	31/08/20	12	2 199	02/09/20	25/11/20	-0,568 %
BTF	31/08/20	23	1 492	02/09/20	10/02/21	-0,579 %
BTF	31/08/20	49	1 693	02/09/20	11/08/21	-0,567 %
<b>TOTAL BTF</b>			<b>31 245</b>			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **4 110 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2021	2 530 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	280 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2022	850 000 000
OAT 3,00 % 25/04/2022	250 000 000
OAT 3,75 % 25/04/2021	200 000 000

► 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
<b>TOTAL OAT</b>				<b>0</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	6 100 000 000,00	6 203 225 806,45
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 :**

Date d'échéance	Montant acheté en USD	Montant vendu en EUR	Taux de Change à terme
16/02/2021	130 000 000,00	109 890 109,89	1,1830
31/03/2021	20 000 000,00	16 887 612,94	1,1843
29/04/2021	28 000 000,00	23 632 680,62	1,1848
15/09/2021	233 000 000,00	196 342 799,36	1,1867

Date d'échéance	Montant acheté en CHF	Montant vendu en EUR	Taux de Change à terme
31/03/2021	35 000 000,00	32 493 153,23	1,07715

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

Au 31 août 2020 : 8 ans et 6 jours