

### Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Septembre 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	3 septembre 2020	5725	7 septembre 2020	25 novembre 2030	101,94 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2020	3 septembre 2020	1960	7 septembre 2020	25 mai 2036	118,07 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	3 septembre 2020	2231	7 septembre 2020	25 mai 2052	106,45 %	-
OAT	4,00 %	25 avril 2020	3 septembre 2020	1264	7 septembre 2020	25 avril 2060	221,09 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	17 septembre 2020	3054	21 septembre 2020	25 février 2023	101,57 %	-
OAT	0,50 %	25 mai 2020	17 septembre 2020	4887	21 septembre 2020	25 mai 2026	105,95 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	17 septembre 2020	2572	21 septembre 2020	25 mai 2028	108,95 %	-
OATei	0,10 %	1 mars 2020	17 septembre 2020	720	21 septembre 2020	1 mars 2026	106,88 %	0,999050
OATei	0,70 %	25 juillet 2020	17 septembre 2020	448	21 septembre 2020	25 juillet 2030	119,24 %	1,051200
OATei	0,10 %	25 juillet 2020	17 septembre 2020	196	21 septembre 2020	25 juillet 2047	131,02 %	1,046230
<b>TOTAL OAT</b>				<b>23 057</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	07/09/20	13	2 296	09/09/20	09/12/20	-0,569 %
BTF	07/09/20	22	1 794	09/09/20	10/02/21	-0,577 %
BTF	07/09/20	48	1 695	09/09/20	11/08/21	-0,575 %
BTF	14/09/20	12	2 451	16/09/20	09/12/20	-0,574 %
BTF	14/09/20	21	1 430	16/09/20	10/02/21	-0,576 %
BTF	14/09/20	51	2 043	16/09/20	08/09/21	-0,573 %
BTF	21/09/20	11	2 584	23/09/20	09/12/20	-0,574 %
BTF	21/09/20	20	1 901	23/09/20	10/02/21	-0,583 %
BTF	21/09/20	50	2 376	23/09/20	08/09/21	-0,581 %
BTF	28/09/20	14	2 220	30/09/20	06/01/21	-0,648 %
BTF	28/09/20	23	1 442	30/09/20	10/03/21	-0,603 %
BTF	28/09/20	49	2 071	30/09/20	08/09/21	-0,601 %
<b>TOTAL BTF</b>			<b>24 303</b>			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **2 915 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2021	925 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	733 000 000
OAT 0,00 % 25/02/2022	132 000 000
OAT 2,25 % 25/10/2022	1 125 000 000

► 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**

	<b>Fin de mois</b>	<b>Moyenne du mois</b>
Encours des pensions livrées		
Prises en pensions	-	-
Mises en pensions	-	-

**► Dépôts et emprunts**

	<b>Fin de mois</b>	<b>Moyenne du mois</b>
Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des États de cette même zone		
Dépôts	400 000 000,00	5 340 000 000,00
Emprunts	-	-

	<b>Fin de mois</b>	<b>Moyenne du mois</b>
Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des agences supranationales		
Dépôts	0,00	0,00
Emprunts	-	-

**► Billets de trésorerie**

	<b>Fin de mois</b>	<b>Moyenne du mois</b>
Encours des billets de trésorerie		
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
23/10/2020	1 310 466,60	1 118 813,80	1,17130

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

Au 30 septembre 2020 : 8 ans et 12 jours

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

Aux OATi : 104,04000 (base 2015)

Aux OATÉi : 105,29000 (base 2015)