

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Septembre 2021**

► **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 2020	2 septembre 2021	6 315	6 septembre 2021	25 novembre 2031	100.51 %	
OAT	0.50 %	25 juin 2021	2 septembre 2021	2 122	6 septembre 2021	25 juin 2044	98.84 %	
OAT	1.50 %	25 mai 2021	2 septembre 2021	1 921	6 septembre 2021	25 mai 2050	120.79 %	
OAT	2.25 %	25 mai 2021	16 septembre 2021	3 138	20 septembre 2021	25 mai 2024	107.87 %	
OAT	0.25 %	25 novembre 2020	16 septembre 2021	2 652	20 septembre 2021	25 novembre 2026	103.81 %	
OAT	0.00 %	25 février 2021	16 septembre 2021	3 208	20 septembre 2021	25 février 2027	102.34 %	
OATei	0.10 %	1 mars 2021	16 septembre 2021	988	20 septembre 2021	1 mars 2026	110.74 %	1.019660
OATei	0.10 %	25 juillet 2021	16 septembre 2021	541	20 septembre 2021	25 juillet 2031	119.28 %	1.021240
OATei	1.80 %	25 juillet 2021	16 septembre 2021	333	20 septembre 2021	25 juillet 2040	166.51 %	1.225320
TOTAL OAT				21 218				

► **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	6 septembre 2021	13	2 991	08/09/21	08/12/21	-0.652 %
BTF	6 septembre 2021	22	1 692	08/09/21	09/02/22	-0.668 %
BTF	6 septembre 2021	48	1 799	08/09/21	10/08/22	-0.655 %
BTF	13 septembre 2021	12	3 233	15/09/21	08/12/21	-0.651 %
BTF	13 septembre 2021	21	2 178	15/09/21	09/02/22	-0.675 %
BTF	13 septembre 2021	51	2 015	15/09/21	07/09/22	-0.649 %
BTF	20 septembre 2021	11	2 890	22/09/21	08/12/21	-0.652 %
BTF	20 septembre 2021	20	2 125	22/09/21	09/02/22	-0.681 %
BTF	20 septembre 2021	50	1 798	22/09/21	07/09/22	-0.657 %
BTF	27 septembre 2021	14	3 417	29/09/21	05/01/22	-0.739 %
BTF	27 septembre 2021	23	2 306	29/09/21	09/03/22	-0.677 %
BTF	27 septembre 2021	49	1 767	29/09/21	07/09/22	-0.650 %
TOTAL BTF			28 211			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **2 210 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/02/2022	1 150 000 000
OAT 3,00% 25/04/2022	1 060 000 000

► **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

► **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	8 110 000 000.00	7 090 333 333.33
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 taux d'intérêts :**

Date d'échéance	Montant acheté en USD	Montant vendu en EUR	Taux de Change à terme
21/10/21	436 822,20	369 126,91	1.183393

► **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 30 septembre 2021 : 8 ans et 138 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er septembre 2021**

Aux OATi : 105,48 (base 2015)

Aux OAT€i : 107,26 (base 2015)