

### Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Octobre 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	1 octobre 2020	6761	5 octobre 2020	25 novembre 2030	102,54 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2020	1 octobre 2020	1957	5 octobre 2020	25 mai 2034	118,32 %	-
OAT	0,50 %	25 mai 2020	1 octobre 2020	2905	5 octobre 2020	25 mai 2040	106,39 %	-
OAT	0,75 %	25 mai 2020	1 octobre 2020	2675	5 octobre 2020	25 mai 2052	109,45 %	-
OAT	0,50 %	25 mai 2020	15 octobre 2020	1900	19 octobre 2020	25 mai 2025	105,64 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	15 octobre 2020	3155	19 octobre 2020	25 février 2026	103,51 %	-
OAT	2,75 %	25 octobre 2019	15 octobre 2020	2185	19 octobre 2020	25 octobre 2027	123,99 %	-
OATei	0,70 %	25 juillet 2020	15 octobre 2020	692	19 octobre 2020	25 juillet 2030	119,84 %	1,047280
OATi	0,10 %	1 mars 2020	15 octobre 2020	556	19 octobre 2020	1 mars 2036	116,81 %	0,999920
<b>TOTAL OAT</b>				<b>22 786</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	05/10/20	13	2 448	07/10/20	06/01/21	-0,636 %
BTF	05/10/20	22	1 662	07/10/20	10/03/21	-0,609 %
BTF	05/10/20	48	2 195	07/10/20	08/09/21	-0,611 %
BTF	12/10/20	12	2 233	14/10/20	06/01/21	-0,656 %
BTF	12/10/20	21	1 582	14/10/20	10/03/21	-0,637 %
BTF	12/10/20	51	2 002	14/10/20	06/10/21	-0,628 %
BTF	19/10/20	13	2 495	21/10/20	20/01/21	-0,685 %
BTF	19/10/20	20	1 597	21/10/20	10/03/21	-0,678 %
BTF	19/10/20	50	1 397	21/10/20	06/10/21	-0,646 %
BTF	26/10/20	12	2 145	28/10/20	20/01/21	-0,673 %
BTF	26/10/20	23	1 530	28/10/20	08/04/21	-0,652 %
BTF	26/10/20	49	1 698	28/10/20	06/10/21	-0,638 %
<b>TOTAL BTF</b>			<b>22 984</b>			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **4 085 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/02/2022	610 000 000
OAT 2,25% 25/10/2022	300 000 000
OAT 3,00% 25/04/2022	75 000 000
OAT 3,25% 25/10/2021	150 000 000
OAT 3,75% 25/04/2021	2 950 000 000

► 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	Prises en pensions	Mises en pensions	Fin de mois	Moyenne du mois
			-	-
			-	-

► **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	6 900 000 000,00	5 945 161 290,32
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

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

Au 31 octobre 2020 : 8 ans et 64 jours

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

Aux OATi : 104,34323 (base 2015)

Aux OATÉi : 104,46452 (base 2015)