

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Novembre 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	0,50 %	25 mai 2020	5 novembre 2020	3497	9 novembre 2020	25 mai 2029	108,71 %	-
OAT	0,00 %	25 novembre 2019	5 novembre 2020	3498	9 novembre 2020	25 novembre 2030	103,90 %	-
OAT	1,50 %	25 mai 2020	5 novembre 2020	2521	9 novembre 2020	25 mai 2050	135,03 %	-
OAT	4,00 %	25 avril 2020	5 novembre 2020	1478	9 novembre 2020	25 avril 2055	220,02 %	-
OAT	1,75 %	25 mai 2020	19 novembre 2020	3314	23 novembre 2020	25 mai 2023	106,22 %	-
OAT	0,00 %	25 février 2020	19 novembre 2020	5327	23 novembre 2020	25 février 2026	130,30 %	-
OAT	2,75 %	25 octobre 2021	19 novembre 2020	1903	23 novembre 2020	25 octobre 2027	123,48 %	-
OATei	0,10 %	1 mars 2020	19 novembre 2020	837	23 novembre 2020	1 mars 2026	107,65 %	0,994160
OATi	0,10 %	1 mars 2020	19 novembre 2020	486	23 novembre 2020	1 mars 2036	117,14 %	0,995730
OATei	0,10 %	25 juillet 2020	19 novembre 2020	424	23 novembre 2020	25 juillet 2036	121,41 %	1,026000
TOTAL OAT				23 285				

► 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	02/11/20	13	3 497	04/11/20	03/02/21	-0,676 %
BTF	02/11/20	22	1 695	04/11/20	08/04/21	-0,653 %
BTF	02/11/20	48	1 498	04/11/20	06/10/21	-0,648 %
BTF	09/11/20	12	3 400	11/11/20	03/02/21	-0,635 %
BTF	09/11/20	21	2 096	11/11/20	08/04/21	-0,628 %
BTF	09/11/20	51	1 996	11/11/20	04/11/21	-0,627 %
BTF	16/11/20	13	3 090	18/11/20	17/02/21	-0,600 %
BTF	16/11/20	20	1 986	18/11/20	08/04/21	-0,601 %
BTF	16/11/20	30	1 122	18/11/20	16/06/21	-0,602 %
BTF	16/11/20	50	2 157	18/11/20	04/11/21	-0,598 %
BTF	23/11/20	12	3 653	25/11/20	17/02/21	-0,634 %
BTF	23/11/20	23	2 298	25/11/20	05/05/21	-0,618 %
BTF	23/11/20	49	1 940	25/11/20	04/11/21	-0,616 %
BTF	30/11/20	13	3 748	02/12/20	03/03/21	-0,655 %
BTF	30/11/20	22	1 829	02/12/20	05/05/21	-0,646 %
BTF	30/11/20	48	1 929	02/12/20	04/11/21	-0,647 %
TOTAL BTF			37 934			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **5 390 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 3,75 % 25/04/2021	4 420 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	180 000 000
OAT 3,25 % 25/10/2021	350 000 000
OAT 0,00 % 25/02/2022	390 000 000
OAT 3,00 % 25/04/2022	50 000 000

► 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
TOTAL OAT				0				

► **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	4 600 000 000,00	6 743 333 333,33
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 30 novembre 2020 : 8 ans et 78 jours

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

Aux OATi : 104,340 (base 2015)

Aux OATÉi : 104,450 (base 2015)