

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Décembre 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	5,75 %	25 octobre 2020	3 décembre 2020	1897	7 décembre 2020	25 octobre 2032	172,62 %	-
OAT	1,25 %	25 mai 2020	3 décembre 2020	2341	7 décembre 2020	25 mai 2036	120,02 %	-
OAT	4,50 %	25 avril 2020	3 décembre 2020	1406	7 décembre 2020	25 avril 2041	188,85 %	-
OAT	2,00 %	25 mai 2020	3 décembre 2020	2350	7 décembre 2020	25 mai 2048	145,01 %	-
TOTAL OAT				7 994				

► **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	07/12/20	12	3 572	09/12/20	03/03/21	-0,7058 %
BTF	07/12/20	21	1 785	09/12/20	05/05/21	-0,6825 %
BTF	07/12/20	51	2 248	09/12/20	01/12/21	-0,6759 %
BTF	14/12/20	11	2 097	16/12/20	03/03/21	-0,7428 %
BTF	14/12/20	20	1 499	16/12/20	05/05/21	-0,7191 %
BTF	14/12/20	50	1 398	16/12/20	01/12/21	-0,6919 %
TOTAL BTF			12 599			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **2 024 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00 % 25/02/2022	1 401 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2021	100 000 000
OAT 0,00 % 25/05/2022	78 000 000
OAT 3,00 % 25/04/2022	205 000 000
OAT 3,25 % 25/10/2021	50 000 000
OAT 3,75 % 25/04/2021	190 000 000

► **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 Etats de cette même zone	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	0,00	3 080 645 161,29
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
15/06/21	12 316 125,00	10 086 916,46	1,221000
15/06/22	12 740 125,00	10 343 361,32	1,231720
15/06/23	12 740 125,00	10 248 672,67	1,243100
17/06/24	12 740 124,00	10 138 567,56	1,256600
19/11/21	49 000 000,00	39 859 596,60	1,229315

► **Contrats d'opération de couverture pétrole :**

Période de couverture	Volume total de barils	Prix exécuté EUR/Baril	Prix limite EUR/Baril	Montant total EUR
1er janvier 2021 - 31 décembre 2021	696 960	41,72	54,54	29 077 171,20
1er janvier 2022 - 31 décembre 2022	634 920	40,46	54,54	25 688 863,20
1er janvier 2023 - 31 décembre 2023	307 920	39,93	54,54	12 295 245,60

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

Au 31 décembre 2020 : 8 ans et 73 jours

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

Aux OATi : 103,80 (base 2015)

Aux OATéi : 104,54 (base 2015)