

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Juin 2023

► 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	3,00 %	25 mai 2023	1 juin 2023	6 388	5 juin 2023	25 mai 2033	101,29 %	
OAT	2,50 %	25 mai 2023	1 juin 2023	1 989	5 juin 2023	25 mai 2043	88,58 %	
OAT	3,00 %	25 mai 2023	1 juin 2023	2 621	5 juin 2023	25 mai 2054	92,94 %	
OAT	2,50 %	24 septembre 2022	15 juin 2023	4 314	19 juin 2023	24 septembre 2026	98,36 %	
OAT	0,75 %	25 novembre 2022	15 juin 2023	2 225	19 juin 2023	25 novembre 2028	89,57 %	
OAT	2,75 %	25 février 2023	15 juin 2023	5 771	19 juin 2023	25 février 2029	99,27 %	
OATeI	0,10 %	1 mars 2023	15 juin 2023	818	19 juin 2023	1 mars 2029	97,66 %	1,176500
OATeI	0,10 %	25 juillet 2022	15 juin 2023	755	19 juin 2023	25 juillet 2031	97,17 %	1,166780
OATeI	0,10 %	25 juillet 2022	15 juin 2023	301	19 juin 2023	25 juillet 2053	85,66 %	1,145620
TOTAL OAT				25 182				

► 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	5 juin 2023	9	400	7 juin 2023	9 août 2023	3,113 %
BTF	5 juin 2023	12	2 729	7 juin 2023	30 août 2023	3,267 %
BTF	5 juin 2023	23	2 035	7 juin 2023	15 novembre 2023	3,394 %
BTF	5 juin 2023	49	1 823	7 juin 2023	15 mai 2024	3,430 %
BTF	12 juin 2023	13	2 698	14 juin 2023	13 septembre 2023	3,323 %
BTF	12 juin 2023	22	1 496	14 juin 2023	15 novembre 2023	3,410 %
BTF	12 juin 2023	32	500	14 juin 2023	24 janvier 2024	3,392 %
BTF	12 juin 2023	48	1 494	14 juin 2023	15 mai 2024	3,429 %
BTF	19 juin 2023	12	2 698	21 juin 2023	13 septembre 2023	3,387 %
BTF	19 juin 2023	21	1 500	21 juin 2023	15 novembre 2023	3,499 %
BTF	19 juin 2023	31	475	21 juin 2023	24 janvier 2024	3,485 %
BTF	19 juin 2023	51	1 755	21 juin 2023	12 juin 2024	3,605 %
BTF	26 juin 2023	13	2 838	28 juin 2023	27 septembre 2023	3,431 %
BTF	26 juin 2023	20	1 941	28 juin 2023	15 novembre 2023	3,532 %
BTF	26 juin 2023	30	399	28 juin 2023	24 janvier 2024	3,551 %
BTF	26 juin 2023	50	1 816	28 juin 2023	12 juin 2024	3,623 %
TOTAL BTF			26 597			

► Rachats de gré à gré :

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : 0 €

► Pensions livrées

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pensions	33 700 019 994,39	37 274 574 175,20
Mises en pensions	0,00	0,00

► 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	20 000 000 000,00	12 983 700 000,00
Emprunts	0,00	16 666 666,67

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

Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des Trésors étrangers	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
Billets de trésorerie émis par la CADES	0,00	1 256 666 666,67

► **Contrats d'opérations d'échange à terme de devise :**

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

Date de début de couverture	Date de fin de couverture	Volume total de barils	Prix exécuté EUR/Baril	Montant total EUR
01/01/2024	31/12/2024	448 596,00	66,42	29 795 746,32
01/01/2025	31/12/2025	313 044,00	63,40	19 846 989,60
01/01/2026	31/12/2026	391 380,00	61,19	23 948 542,20

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

Au 30 juin 2023 : 8 ans et 184 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er juin 2023**

Aux OATi : 115,92 (base 2015)

Aux OAT€i : 122 (base 2015)