

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT et de la CDP (en euros) Juin 2024

Emissions moyen et long terme

Type d'émission	Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date d'émission	Montant émis (en M d'euros)	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
Adjudication	OAT	3,00%	25/11/2023	06/06/2024	7 174	10/06/2024	25/11/2034	99,51%	
Adjudication	OAT	1,25%	25/05/2024	06/06/2024	2 870	10/06/2024	25/05/2038	78,23%	
Adjudication	OAT	3,25%	25/05/2024	06/06/2024	1 956	10/06/2024	25/05/2055	96,03%	
Adjudication	OAT	2,75%	25/10/2023	20/06/2024	3 763	24/06/2024	25/10/2027	99,10%	
Adjudication	OAT	5,50%	25/04/2024	20/06/2024	3 100	24/06/2024	25/04/2029	110,93%	
Adjudication	OAT	2,75%	25/02/2024	20/06/2024	3 939	24/06/2024	25/02/2030	98,65%	
Adjudication	OAT	0,00%	25/05/2024	20/06/2024	2 324	24/06/2024	25/05/2032	78,82%	
Adjudication	OATi	0,10%	01/03/2024	20/06/2024	492	24/06/2024	01/03/2036	89,91%	1,138690
Adjudication	OATei	1,85%	25/07/2023	20/06/2024	1 129	24/06/2024	25/07/2027	102,89%	1,337970
Adjudication	OATei	0,10%	25/07/2023	20/06/2024	580	24/06/2024	25/07/2036	89,53%	1,231040
Adjudication	OATei	0,10%	25/07/2023	20/06/2024	300	24/06/2024	25/07/2053	77,17%	1,173000
TOTAL OAT					27 627				

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	03/06/2024	12	3 553	05/06/2024	28/08/2024	3,686%
BTF	03/06/2024	25	452	05/06/2024	27/11/2024	3,600%
BTF	03/06/2024	27	2 126	05/06/2024	11/12/2024	3,606%
BTF	03/06/2024	50	2 099	05/06/2024	21/05/2025	3,487%
BTF	10/06/2024	13	3 635	12/06/2024	11/09/2024	3,681%
BTF	10/06/2024	14	599	12/06/2024	18/09/2024	3,647%
BTF	10/06/2024	26	1 817	12/06/2024	11/12/2024	3,624%
BTF	10/06/2024	49	1 669	12/06/2024	21/05/2025	3,517%
BTF	17/06/2024	12	4 311	19/06/2024	11/09/2024	3,703%
BTF	17/06/2024	26	1 819	19/06/2024	18/12/2024	3,643%
BTF	17/06/2024	40	798	19/06/2024	26/03/2025	3,477%
BTF	17/06/2024	52	1 713	19/06/2024	18/06/2025	3,452%
BTF	24/06/2024	13	4 139	26/06/2024	25/09/2024	3,699%
BTF	24/06/2024	25	2 007	26/06/2024	18/12/2024	3,628%
BTF	24/06/2024	51	1 889	26/06/2024	18/06/2025	3,437%
TOTAL BTF			32 626			

Rachats de gré à gré
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État :
2 960 M€

Libellé du contrat	Nominal de l'opération (en M d'euros)
OAT 0,00% 25/03/2025	2 200
OAT 0,50% 25/05/2025	150
OATi 0,10% 01/03/2025	610

Pensions livrées de l'AFT

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pension	27 049 999 663,89	14 909 623 634,81
Mises en pension	0,00	333,33

Titres émis au profit de la CDP

Titres	Montants nominaux en €
OAT 0,00% 25/11/2029	2 000 000 000
OAT 0,00% 25/11/2030	2 000 000 000
OAT 0,00% 25/11/2031	2 000 000 000
OAT 0,25% 25/11/2026	2 000 000 000
OAT 0,75% 25/11/2028	2 000 000 000
OAT 2,00% 25/11/2032	2 000 000 000
OAT 2,50% 24/09/2026	2 000 000 000
OAT 2,75% 25/10/2027	2 000 000 000
OAT 3,50% 25/11/2033	2 000 000 000
OAT 5,75% 25/10/2032	2 000 000 000

Pensions livrées de la CDP pour la facilité de repo

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pension	0,00	0,00
Mises en pension	0,00	0,00

Pensions livrées de la CDP pour la réserve de titres

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pension	0,00	0,00
Mises en pension	0,00	666,73

Dépôts et emprunts

Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	20 000 000 000	16 337 166 667
Emprunts	0,00	0,00
Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des institutions et agences européennes	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	0,00	0,00
Emprunts	0,00	0,00

Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des Trésors de la zone euro	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	0,00	26 666 666,67
Empunts	0,00	1 250 000 000

Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des établissements publics français et de la SPPE	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	1 000 000 000	1 000 000 000
Empunts	0,00	666,73

Achats des 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	0,00

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

30/06/2024 : 8 ans et 188 jours

Références d'inflation applicables au 01/06/2024

Aux OATis : 118,4 (base 2015)

Aux OATéis : 124,85 (base 2015)