

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT
(en euros)
Juillet 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%	25/05/2024	04/07/2024	4 700,00	08/07/2024	25/05/2033	98,70%	
Adjudication	OAT	1,25%	25/05/2024	04/07/2024	4 608,00	08/07/2024	25/05/2034	83,48%	
Adjudication	OAT	0,75%	25/05/2024	04/07/2024	2 247,00	08/07/2024	25/05/2053	49,25%	
Adjudication	OAT	1,75%	25/05/2024	04/07/2024	1 566,00	08/07/2024	25/05/2066	62,15%	
Adjudication	OAT	1,00%	25/05/2024	18/07/2024	3 805,00	22/07/2024	25/05/2027	95,00%	
Adjudication	OAT	2,50%	24/09/2023	18/07/2024	3 440,00	22/07/2024	24/09/2027	98,93%	
Adjudication	OAT	2,75%	25/02/2024	18/07/2024	2 922,00	22/07/2024	25/02/2030	99,38%	
Adjudication	OAT	2,00%	25/11/2023	18/07/2024	2 088,00	22/07/2024	25/11/2032	92,98%	
Adjudication	OATi	0,10%	01/03/2024	18/07/2024	519,00	22/07/2024	01/03/2028	96,45%	1,189900
Adjudication	OATei	0,10%	01/03/2024	18/07/2024	812,00	22/07/2024	01/03/2029	96,67%	1,208000
Adjudication	OATei	0,60%	25/07/2023	18/07/2024	768,00	22/07/2024	25/07/2034	97,36%	1,088550
Adjudication	OATei	0,10%	25/07/2023	18/07/2024	400,00	22/07/2024	25/07/2053	77,96%	1,176290
TOTAL OAT					27 875,00				

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	01/07/2024	12	3 932,00	03/07/2024	25/09/2024	3,687%
BTF	01/07/2024	21	628,00	03/07/2024	27/11/2024	3,623%
BTF	01/07/2024	28	1 695,00	03/07/2024	15/01/2025	3,589%
BTF	01/07/2024	50	1 475,00	03/07/2024	18/06/2025	3,477%
BTF	08/07/2024	8	541,00	10/07/2024	04/09/2024	3,668%
BTF	08/07/2024	13	3 744,00	10/07/2024	09/10/2024	3,674%
BTF	08/07/2024	27	1 568,00	10/07/2024	15/01/2025	3,572%
BTF	08/07/2024	49	1 882,00	10/07/2024	18/06/2025	3,439%
BTF	15/07/2024	12	4 494,00	17/07/2024	09/10/2024	3,657%
BTF	15/07/2024	15	596,00	17/07/2024	30/10/2024	3,602%
BTF	15/07/2024	26	2 126,00	17/07/2024	15/01/2025	3,537%
BTF	15/07/2024	52	2 252,00	17/07/2024	17/07/2025	3,355%
BTF	22/07/2024	13	4 083,00	24/07/2024	23/10/2024	3,637%
BTF	22/07/2024	16	428,00	24/07/2024	14/11/2024	3,576%
BTF	22/07/2024	25	1 996,00	24/07/2024	15/01/2025	3,540%
BTF	22/07/2024	51	2 163,00	24/07/2024	17/07/2025	3,341%
BTF	29/07/2024	9	967,00	31/07/2024	02/10/2024	3,612%
BTF	29/07/2024	12	4 477,00	31/07/2024	23/10/2024	3,610%
BTF	29/07/2024	28	2 188,00	31/07/2024	12/02/2025	3,456%
BTF	29/07/2024	50	1 862,00	31/07/2024	17/07/2025	3,252%
TOTAL BTF			43 097,00			

Rachats de gré à gré
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : 665,00 M€

Libellé du contrat	Nominal de l'opération (en M d'euros)
OAT 0,00% 25/03/2025	615,00
OAT 0,50% 25/05/2025	50,00

Pensions livrées de l'AFT

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pension	1 499 999 999,69	23 070 423 492,92
Mises en pension	0,00	0,00

Titres émis au profit de la CDP

Titres	Montants nominaux en €
OAT 0,00% 25/02/2027	2 000 000 000,00
OAT 0,50% 25/05/2029	2 000 000 000,00
OAT 0,75% 25/02/2028	2 000 000 000,00
OAT 0,75% 25/05/2028	2 000 000 000,00
OAT 1,00% 25/05/2027	2 000 000 000,00
OAT 1,50% 25/05/2031	2 000 000 000,00
OAT 2,50% 25/05/2030	2 000 000 000,00
OAT 2,75% 25/02/2029	2 000 000 000,00
OAT 3,00% 25/05/2033	2 000 000 000,00
OAT 5,50% 25/04/2029	2 000 000 000,00

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	0,00

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	12 500 000 000,00	16 816 645 161,29
Empunts	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
Empunts	0,00	322,58

Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des Trésors de la zone euro	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	0,00	1 580 645 161,29
Empunts	0,00	0,00

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

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

Au 31/07/2024 : 8 ans et 181 jours

Références d'inflation applicables au 01/07/2024

Aux OATis : 119,01 (base 2015)

Aux OATéïs : 125,57 (base 2015)