

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT
(en euros)
septembre 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 | 05/09/2024 | 8 658 | 09/09/2024 | 25/11/2034 | 100,46% | |
| Adjudication | OAT | 1,25% | 25/05/2024 | 05/09/2024 | 1 701 | 09/09/2024 | 25/05/2036 | 82,59% | |
| Adjudication | OAT | 0,50% | 25/05/2024 | 05/09/2024 | 2 233 | 09/09/2024 | 25/05/2040 | 66,83% | |
| Adjudication | OAT | 3,25% | 25/05/2024 | 05/09/2024 | 2 411 | 09/09/2024 | 25/05/2055 | 95,43% | |
| Adjudication | OAT | 2,50% | 24/09/2023 | 19/09/2024 | 4 070 | 23/09/2024 | 24/09/2027 | 100,13% | |
| Adjudication | OAT | 0,75% | 25/02/2024 | 19/09/2024 | 1 952 | 23/09/2024 | 25/02/2028 | 94,43% | |
| Adjudication | OAT | 2,75% | 25/02/2024 | 19/09/2024 | 3 567 | 23/09/2024 | 25/02/2030 | 100,64% | |
| Adjudication | OAT | 2,00% | 25/11/2023 | 19/09/2024 | 2 407 | 23/09/2024 | 25/11/2032 | 94,42% | |
| Adjudication | OATi | 0,10% | 01/03/2024 | 19/09/2024 | 816 | 23/09/2024 | 01/03/2032 | 94,10% | 1,146210 |
| Adjudication | OATei | 3,15% | 25/07/2024 | 19/09/2024 | 330 | 23/09/2024 | 25/07/2032 | 118,07% | 1,555140 |
| Adjudication | OATei | 1,80% | 25/07/2024 | 19/09/2024 | 530 | 23/09/2024 | 25/07/2040 | 109,67% | 1,440550 |
| Adjudication | OATei | 0,10% | 25/07/2024 | 19/09/2024 | 323 | 23/09/2024 | 25/07/2053 | 75,33% | 1,178840 |
| TOTAL OAT | | | | | 28 998,00 | | | | |

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 | 02/09/2024 | 13 | 3 370 | 04/09/2024 | 04/12/2024 | 3,462% |
| BTF | 02/09/2024 | 19 | 543 | 04/09/2024 | 15/01/2025 | 3,357% |
| BTF | 02/09/2024 | 27 | 1 796 | 04/09/2024 | 12/03/2025 | 3,308% |
| BTF | 02/09/2024 | 49 | 1 809 | 04/09/2024 | 13/08/2025 | 2,997% |
| BTF | 09/09/2024 | 12 | 3 542 | 11/09/2024 | 04/12/2024 | 3,435% |
| BTF | 09/09/2024 | 14 | 639 | 11/09/2024 | 18/12/2024 | 3,396% |
| BTF | 09/09/2024 | 26 | 1 934 | 11/09/2024 | 12/03/2025 | 3,258% |
| BTF | 09/09/2024 | 52 | 2 132 | 11/09/2024 | 10/09/2025 | 2,859% |
| BTF | 16/09/2024 | 13 | 3 529 | 18/09/2024 | 18/12/2024 | 3,397% |
| BTF | 16/09/2024 | 25 | 2 033 | 18/09/2024 | 12/03/2025 | 3,227% |
| BTF | 16/09/2024 | 51 | 1 798 | 18/09/2024 | 10/09/2025 | 2,823% |
| BTF | 23/09/2024 | 12 | 4 330 | 25/09/2024 | 18/12/2024 | 3,367% |
| BTF | 23/09/2024 | 16 | 844 | 25/09/2024 | 15/01/2025 | 3,251% |
| BTF | 23/09/2024 | 28 | 2 502 | 25/09/2024 | 09/04/2025 | 3,116% |
| BTF | 23/09/2024 | 50 | 2 255 | 25/09/2024 | 10/09/2025 | 2,789% |
| BTF | 30/09/2024 | 9 | 605 | 02/10/2024 | 04/12/2024 | 3,269% |
| BTF | 30/09/2024 | 14 | 4 303 | 02/10/2024 | 08/01/2025 | 3,250% |
| BTF | 30/09/2024 | 27 | 2 457 | 02/10/2024 | 09/04/2025 | 3,028% |
| BTF | 30/09/2024 | 49 | 1 846 | 02/10/2024 | 10/09/2025 | 2,714% |
| TOTAL BTF | | | 42 267,00 | | | |

Rachats de gré à gré
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État :
8495,00 M€

| Libellé du contrat | Nominal de l'opération (en M d'euros) |
|----------------------|---------------------------------------|
| OAT 0,00% 25/02/2025 | 670,00 |
| OAT 0,00% 25/02/2026 | 1 330,00 |
| OAT 0,00% 25/03/2025 | 2 310,00 |
| OAT 0,50% 25/05/2025 | 1 405,00 |
| OAT 0,50% 25/05/2026 | 1 670,00 |
| OAT 1,00% 25/11/2025 | 10,00 |
| OAT 6,00% 25/10/2025 | 1 100,00 |

Pensions livrées de l'AFT

| Encours des pensions livrées | Fin de mois | Moyenne du mois |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| Prises en pension | 32 730 627 917,02 | 22 158 596 506,58 |
| Mises en pension | 0,00 | 0,00 |

Titres émis au profit de la CDP

| Titres | Montants nominaux en € |
|--------|------------------------|
| - | - |

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 | 1 660 000 000,03 |

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 | 17 379 000 000,00 | 17 267 933 333,33 |
| 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 | 5 600 000 000,00 |

| Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des Trésors de la zone euro | 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 établissements publics français et de la SPPE | Fin de mois | Moyenne du mois |
|--|--------------------|------------------------|
| Dépôts | 1 000 000 000,00 | 1 000 000 000,00 |
| Emprunts | 0,00 | 1 660 000 000,03 |

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

A 30/09/2024 : 8 ans et 161 jours

Références d'inflation applicables au 01/09/2024

Aux OATis : 119,14 (base 2015)

Aux OATéis : 126,07 (base 2015)

