

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Octobre 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	1,25%	25/05/2024	03/10/2024	2 485	07/10/2024	25/05/2034	86,58%	
Adjudication	OAT	3,00%	25/11/2023	03/10/2024	6 165	07/10/2024	25/11/2034	100,72%	
Adjudication	OAT	3,00%	25/06/2024	03/10/2024	1 917	07/10/2024	25/06/2049	93,06%	
Adjudication	OAT	3,25%	25/05/2024	03/10/2024	1 415	07/10/2024	25/05/2055	94,49%	
Adjudication	OAT	2,50%	24/09/2024	17/10/2024	4 532	21/10/2024	24/09/2027	100,23%	
Adjudication	OAT	0,75%	25/05/2024	17/10/2024	1 822	21/10/2024	25/05/2028	94,22%	
Adjudication	OAT	2,75%	25/02/2024	17/10/2024	4 738	21/10/2024	25/02/2029	100,89%	
Adjudication	OAT	2,75%	25/02/2024	17/10/2024	3 908	21/10/2024	25/02/2030	100,68%	
Adjudication	OATi	0,10%	01/03/2024	17/10/2024	641	21/10/2024	01/03/2036	90,06%	1,147460
Adjudication	OATei	0,10%	01/03/2024	17/10/2024	1 056	21/10/2024	01/03/2029	97,46%	1,211520
Adjudication	OATei	0,60%	25/07/2024	17/10/2024	598	21/10/2024	25/07/2034	97,62%	1,091730
Adjudication	OATei	1,80%	25/07/2024	17/10/2024	353	21/10/2024	25/07/2040	110,75%	1,441620
TOTAL OAT					29 630				

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	01/10/2024	9	108	02/10/2024	04/12/2024	3,270%
BTF	01/10/2024	14	805	02/10/2024	08/01/2025	3,250%
BTF	01/10/2024	27	458	02/10/2024	09/04/2025	3,030%
BTF	01/10/2024	49	349	02/10/2024	10/09/2025	2,715%
BTF	07/10/2024	7	413	09/10/2024	27/11/2024	3,227%
BTF	07/10/2024	13	5 239	09/10/2024	08/01/2025	3,167%
BTF	07/10/2024	26	1 698	09/10/2024	09/04/2025	3,016%
BTF	07/10/2024	52	1 485	09/10/2024	08/10/2025	2,746%
BTF	14/10/2024	14	4 054	16/10/2024	22/01/2025	3,138%
BTF	14/10/2024	25	2 370	16/10/2024	09/04/2025	2,994%
BTF	14/10/2024	31	836	16/10/2024	21/05/2025	2,897%
BTF	14/10/2024	51	2 748	16/10/2024	08/10/2025	2,730%
BTF	21/10/2024	7	979	23/10/2024	11/12/2024	3,155%
BTF	21/10/2024	13	3 494	23/10/2024	22/01/2025	3,071%
BTF	21/10/2024	28	1 997	23/10/2024	07/05/2025	2,824%
BTF	21/10/2024	50	1 997	23/10/2024	08/10/2025	2,593%
BTF	28/10/2024	13	475	30/10/2024	29/01/2025	3,039%
BTF	28/10/2024	14	3 697	30/10/2024	05/02/2025	3,055%
BTF	28/10/2024	27	1 798	30/10/2024	07/05/2025	2,778%
BTF	28/10/2024	49	1 798	30/10/2024	08/10/2025	2,531%
TOTAL BTF			36 798			

Rachats de gré à gré
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État :
19655,50 M€

Libellé du contrat	Nominal de l'opération (en M d'euros)
OAT 0,00% 25/02/2025	860,00
OAT 0,00% 25/02/2026	3150,50
OAT 0,00% 25/03/2025	840,00
OAT 0,50% 25/05/2025	1380,00
OAT 0,50% 25/05/2026	3160,00
OAT 1,00% 25/11/2025	250,00
OAT 2,50% 24/09/2026	5350,00
OAT 3,50 % 25/04/2026	2815,00
OAT 6,00% 25/10/2025	900,00
OATi 0.10% 01/03/2025	950,00

Pensions livrées de l'AFT

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pension	52 350 003 378,99	31 474 977 853,97
Mises en pension	0,00	0,00

Titres émis au profit de la CDP

Titres	Montants nominaux en €
OATi 0,55% 01/03/2039	88 000 000,00

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	1 391 699,25
Mises en pension	0,00	1 391 699,25

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	12 450 000 000,00	17 346 354 838,71
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	0,00

Encours des dépôts et emprunts de liquidités auprès des Trésors de la zone euro	Fin de mois	Moyenne du mois
Dépôts	4 000 000 000,00	4 677 419 354,84
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 31/10/2024 : 8 ans et 155 jours

Références d'inflation applicables au 01/10/2024

Aux OATis : 119,37 (base 2015)

Aux OAT€is : 126,01 (base 2015)