

**Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Décembre 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	2,75 %	25 octobre 2023	7 décembre 2023	988	11 décembre 2023	25 octobre 2027	101,08 %	
OAT	0,00 %	25 mai 2023	7 décembre 2023	1 318	11 décembre 2023	25 mai 2032	80,56 %	
OAT	1,25 %	25 mai 2023	7 décembre 2023	2 010	11 décembre 2023	25 mai 2034	86,50 %	
OATeI	0,10 %	1 mars 2023	7 décembre 2023	680	11 décembre 2023	1 mars 2029	98,24 %	1,192080
TOTAL OAT				4 996				

► **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	4 décembre 2023	12	3 079	6 décembre 2023	28 février 2024	3,766 %
BTF	4 décembre 2023	21	2 372	6 décembre 2023	2 mai 2024	3,739 %
BTF	4 décembre 2023	31	656	6 décembre 2023	10 juillet 2024	3,553 %
BTF	4 décembre 2023	51	2 504	6 décembre 2023	27 novembre 2024	3,393 %
BTF	11 décembre 2023	13	3 097	13 décembre 2023	13 mars 2024	3,778 %
BTF	11 décembre 2023	14	399	13 décembre 2023	20 mars 2024	3,732 %
BTF	11 décembre 2023	20	1 796	13 décembre 2023	2 mai 2024	3,739 %
BTF	11 décembre 2023	50	1 375	13 décembre 2023	27 novembre 2024	3,423 %
BTF	18 décembre 2023	12	1 578	20 décembre 2023	13 mars 2024	3,729 %
BTF	18 décembre 2023	23	1 194	20 décembre 2023	29 mai 2024	3,690 %
BTF	18 décembre 2023	49	713	20 décembre 2023	27 novembre 2024	3,333 %
TOTAL BTF			18 763			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'État : **1 966 000 000 €**

Libellé du contrat	Nominal de l'opération
OAT 0,00% 25/02/2025	1 616 000 000
OAT 0,00% 25/03/2025	100 000 000
OAT 0,50% 25/05/2025	50 000 000
OAT 1,00% 25/11/2025	200 000 000

► **Pensions livrées**

Encours des pensions livrées	Fin de mois	Moyenne du mois
Prises en pensions	4 000 000 000,00	3 320 590 036,42
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	17 940 000 000,00	15 006 032 258,06
Emprunts	0,00	6 451 645,17

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	580 645 193,55

	Fin de mois	Moyenne du mois
Encours des dépôts et emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro, auprès des Trésors étrangers		
Dépôts	0,00	290 322 612,90
Emprunts	0,00	516 129 129,03

► **Billets de trésorerie**

	Fin de mois	Moyenne du mois
Encours des billets de trésorerie		
Billets de trésorerie émis par l'ACOSS	0,00	0,00
Billets de trésorerie émis par la CADES	0,00	0,00

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

Maturity date	Devise	Montant acheté en devise	Montant vendu en EUR	Taux de change à terme
03/03/2025	USD	50 000 000	45 330 915,68	1,10300
02/03/2026	USD	50 000 000	44 567 251,98	1,12190
01/03/2027	USD	50 000 000	43 909 721,61	1,13870

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

pas d'opération

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

Au 31 décembre 2023 : 8 ans et 168 jours

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

Aux OATi : 117,37 (base 2015)

Aux OATéi : 124,06 (base 2015)

*Mis à jour le 06/03/2024