

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) septembre 2011

► Adjudications d'OAT

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date d'adjudication	Montant émis	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
OAT	5,00%	25/10/2010	01/09/2011	3 569 000 000	06/09/2011	25/10/2016	114,89%	-
OAT	3,25%	25/10/2010	01/09/2011	3 840 000 000	06/09/2011	25/10/2021	102,99%	-
OAT	4,50%	25/04/2011	01/09/2011	1 586 000 000	06/09/2011	25/04/2041	113,77%	-
OAT	4,00%	25/04/2011	15/09/2011	2 671 000 000	20/09/2011	25/04/2014	107,28%	-
OATi	1,30%	25/07/2011	15/09/2011	380 000 000	20/09/2011	25/07/2019	103,90%	1,033880
OATei	1,10%	25/07/2011	15/09/2011	1 049 000 000	20/09/2011	25/07/2022	99,22%	1,038930
TOTAL OAT				13 095 000 000				

► Adjudications de BTAN

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date d'adjudication	Montant émis	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
BTAN	2,00%	25/09/2010	15/09/2011	2 438 000 000	20/09/2011	25/09/2013	101,83%	-
BTAN	2,50%	25/07/2011	15/09/2011	4 656 000 000	20/09/2011	25/07/2016	103,23%	-
TOTAL BTAN				7 094 000 000				

► Adjudications de BTF

Type d'obligation	Date d'adjudication	Durée (en semaines)	Montant (en M d'euros)	Date de règlement	Date d'échéance	Taux moyen pondéré (%)
BTF	05/09/2011	13	4 922	08/09/2011	08/12/2011	0,554
BTF	05/09/2011	28	2 003	08/09/2011	22/03/2012	0,564
BTF	05/09/2011	50	1 501	08/09/2011	23/08/2012	0,627
BTF	12/09/2011	12	4 507	15/09/2011	08/12/2011	0,455
BTF	12/09/2011	27	2 007	15/09/2011	22/03/2012	0,444
BTF	12/09/2011	49	1 005	15/09/2011	23/08/2012	0,527
BTF	19/09/2011	13	4 794	22/09/2011	22/12/2011	0,460
BTF	19/09/2011	26	2 652	22/09/2011	22/03/2012	0,496
BTF	19/09/2011	48	1 066	22/09/2011	23/08/2012	0,591
BTF	26/09/2011	12	4 066	29/09/2011	22/12/2011	0,370
BTF	26/09/2011	21	1 500	29/09/2011	23/02/2012	0,382
BTF	26/09/2011	51	2 005	29/09/2011	20/09/2012	0,531
TOTAL BTF			32 028			

► Rachats de gré à gré :
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 3 806 000 000 €

OAT 5,00% 25 avril 2012 :	100 000 000 €
BTAN 4,50% 12 juillet 2012 :	200 000 000 €
OATei 1,10% 12 juillet 2012 :	300 000 000 €
BTAN 0,75% 20 septembre 2012 :	296 000 000 €
OAT 4,75% 25 octobre 2012 :	235 000 000 €
BTAN 3,75% 12 janvier 2013 :	2 675 000 000 €

► Repo et dépôt

	au 30 septembre 2011	en moyenne sur le mois de septembre 2011	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	7 700 531 172,25	6 652 298 035,13	
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro et auprès des Etats de cette même zone	Interbancaire	Zone euro	Total
Encours fin de mois	17 170 000 000,00	-	17 170 000 000,00
Encours moyen	15 560 000 000,00	-	15 560 000 000,00

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits

	au 30 septembre 2011	en moyenne sur le mois de septembre 2011
	-	-

► Contrats d'échange de taux d'intérêts

Volume nominal négocié au cours du mois : 650 000 000 €

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

Au 30 septembre 2011 : 7 ans et 58 jours

► Références d'inflation applicables au 1er septembre 2011

 Aux OATi : 122,49
 Aux OATei : 112,75