

## Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Octobre 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	3,75%	25/04/2011	06/10/2011	1 685 000 000	11/10/2011	25/04/2017	109,08%	-
OAT	4,00%	25/04/2011	06/10/2011	1 425 000 000	11/10/2011	25/04/2018	110,89%	-
OAT	3,25%	25/10/2010	06/10/2011	4 388 000 000	11/10/2011	25/10/2021	104,63%	-
OATei	1,10%	25/07/2011	20/10/2011	432 000 000	25/10/2011	25/07/2022	96,20%	1,037920
OATei	1,85%	25/07/2011	20/10/2011	314 000 000	25/10/2011	25/07/2027	100,84%	1,022830
<b>TOTAL OAT</b>				<b>8 244 000 000</b>				

### 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%	25/09/2011	20/10/2011	2 871 000 000	25/10/2011	25/09/2013	101,29%	-
BTAN	3,00%	12/07/2011	20/10/2011	1 229 000 000	25/10/2011	12/07/2014	103,74%	-
BTAN	2,00%	12/07/2011	20/10/2011	2 396 000 000	25/10/2011	12/07/2015	100,12%	-
BTAN	2,50%	25/07/2011	20/10/2011	1 943 000 000	25/10/2011	25/07/2016	100,83%	-
BTANi	0,45%	25/07/2011	20/10/2011	1 231 000 000	25/10/2011	25/07/2016	98,69%	1,020290
<b>TOTAL BTAN</b>				<b>9 670 000 000</b>				

**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	03/10/2011	13	4 503	06/10/2011	05/01/2012	0,340
BTF	03/10/2011	28	2 036	06/10/2011	19/04/2012	0,491
BTF	03/10/2011	50	1 030	06/10/2011	20/09/2012	0,574
BTF	10/10/2011	12	3 804	13/10/2011	05/01/2012	0,503
BTF	10/10/2011	23	1 010	13/10/2011	22/03/2012	0,508
BTF	10/10/2011	27	1 503	13/10/2011	19/04/2012	0,538
BTF	10/10/2011	49	1 508	13/10/2011	20/09/2012	0,649
BTF	17/10/2011	13	4 505	20/10/2011	19/01/2012	0,431
BTF	17/10/2011	16	1 000	20/10/2011	09/02/2012	0,444
BTF	17/10/2011	26	1 004	20/10/2011	19/04/2012	0,553
BTF	17/10/2011	48	1 503	20/10/2011	20/09/2012	0,661
BTF	24/10/2011	12	4 528	27/10/2011	19/01/2012	0,696
BTF	24/10/2011	25	1 023	27/10/2011	19/04/2012	0,707
BTF	24/10/2011	31	1 027	27/10/2011	31/05/2012	0,716
BTF	24/10/2011	47	1 052	27/10/2011	20/09/2012	0,834
BTF	31/10/2011	13	4 531	03/11/2011	02/02/2012	0,560
BTF	31/10/2011	20	1 010	03/11/2011	22/03/2012	0,660
BTF	31/10/2011	28	2 015	03/11/2011	16/05/2012	0,687
<b>TOTAL BTF</b>			<b>38 592</b>			

► **Rachats de gré à gré :**

**Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat :** **330 000 000 €**

BTAN 3,75% 12 janvier 2013 : 250 000 000 €

OAT 4,00% avril 2013 : 80 000 000 €

► <b>Repo et dépôt</b>	au 31 octobre 2011		en moyenne sur le mois d'octobre 2011	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	-		7 376 356 014,19	
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la	Interbancaire		Zone euro	Total
Encours fin de mois	26 545 000 000,00		-	26 545 000 000,00
Encours moyen	22 922 580 645,16		322 580 645,16	23 245 161 290,32

► <b>Billets de trésorerie ACOSS souscrits</b>	au 31 octobre 2011		en moyenne sur le mois d'octobre 2011	
	-		-	

► **Contrats d'échange de taux d'intérêts**

Volume nominal négocié au cours du mois : 0 €

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

Au 31 octobre 2011 : 7 ans et 66 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er octobre 2011**

Aux OATi : 121,94

Aux OATei : 112,03