

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Mai 2012

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	4,25%	25/10/2011	03/05/2012	1 086 000 000	09/05/2012	25/10/2017	112,11%	-
OAT	3,25%	25/10/2011	03/05/2012	1 728 000 000	09/05/2012	25/10/2021	103,26%	-
OAT	3,00%	25/04/2012	03/05/2012	4 199 000 000	09/05/2012	25/04/2022	100,37%	-
OAT	6,00%	25/10/2011	03/05/2012	1 907 000 000	09/05/2012	25/10/2025	128,79%	-
OAT	3,50%	25/04/2012	16/05/2012	1 155 000 000	22/05/2012	25/04/2015	107,33%	-
OAT	3,25%	25/04/2012	16/05/2012	1 089 000 000	22/05/2012	25/04/2016	107,15%	-
OATei	1,10%	25/07/2011	16/05/2012	428 000 000	22/05/2012	25/07/2022	98,60%	1,059760
OATi	2,10%	25/07/2011	16/05/2012	674 000 000	22/05/2012	25/07/2023	109,51%	1,083770
OATei	1,85%	25/07/2011	16/05/2012	255 000 000	22/05/2012	25/07/2027	105,25%	1,044360
TOTAL OAT				12 521 000 000				

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	0,75%	25/09/2011	16/05/2012	2 941 000 000	22/05/2012	25/09/2014	100,02%	-
BTAN	1,75%	25/02/2012	16/05/2012	4 422 000 000	22/05/2012	25/02/2017	100,11%	-
TOTAL BTAN				7 363 000 000				

▶ 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	07/05/2012	12	3 998	10/05/2012	02/08/2012	0,082
BTF	07/05/2012	25	1 792	10/05/2012	31/10/2012	0,114
BTF	07/05/2012	51	2 192	10/05/2012	02/05/2013	0,174
BTF	14/05/2012	13	4 210	16/05/2012	16/08/2012	0,074
BTF	14/05/2012	24	1 775	16/05/2012	31/10/2012	0,111
BTF	14/05/2012	50	1 530	16/05/2012	02/05/2013	0,185
BTF	21/05/2012	12	4 232	24/05/2012	16/08/2012	0,070
BTF	21/05/2012	23	2 218	24/05/2012	31/10/2012	0,096
BTF	21/05/2012	49	2 208	24/05/2012	02/05/2013	0,168
BTF	29/05/2012	13	4 193	31/05/2012	30/08/2012	0,084
BTF	29/05/2012	22	1 439	31/05/2012	31/10/2012	0,106
BTF	29/05/2012	52	2 454	31/05/2012	30/05/2013	0,180
TOTAL BTF			32 241			

► Rachats de gré à gré :
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 1 600 000 000 €

OAT 4,00% 25 avril 2013 :	135 000 000 €
BTAN 4,50% 12 juillet 2013	1 100 000 000 €
BTAN 2,00% 25 septembre 2013 :	265 000 000 €
OAT 4,00% 25 octobre 2013 :	100 000 000 €

Repo et dépôt	au 31 mai 2012	en moyenne sur le mois de mai 2012	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	-	187 284 283,87	
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la	Interbancaire	Zone euro	Total
Encours fin de mois	25 000 000 000,00	-	25 000 000 000,00
Encours moyen	9 677 096 774,19	-	9 677 096 774,19

Billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 31 mai 2012	en moyenne sur le mois de mai 2012	
	-	-	

► 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 mai 2012 : 7 ans et 25 jours

► Références d'inflation applicables au 1er mai 2012

Aux OATi :	123,58
Aux OATei :	113,53