

## Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Juin 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%	25/04/2012	07/06/2012	1 710 000 000	12/06/2012	24/04/2019	114,88%	-
OAT	3,00%	25/04/2012	07/06/2012	3 480 000 000	12/06/2012	25/04/2022	104,65%	-
OAT	3,50%	25/04/2012	07/06/2012	1 961 000 000	12/06/2012	25/04/2026	106,79%	-
OAT	4,00%	25/04/2012	07/06/2012	685 000 000	12/06/2012	25/04/2060	117,64%	-
OATei	1,10%	25/07/2011	21/06/2012	469 000 000	26/06/2012	25/07/2022	101,42%	1,068330
OATi	2,10%	25/07/2011	21/06/2012	490 000 000	26/06/2012	25/07/2023	112,49%	1,087960
OATei	1,85%	25/07/2011	21/06/2012	482 000 000	26/06/2012	25/07/2027	108,47%	1,052800
<b>TOTAL OAT</b>				<b>9 277 000 000</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	0,75%	25/09/2011	21/06/2012	2 775 000 000	26/06/2012	25/09/2014	100,47%	-
BTAN	2,00%	12/07/2011	21/06/2012	1 550 000 000	26/06/2012	12/07/2015	103,50%	-
BTAN	2,25%	25/02/2012	21/06/2012	1 432 000 000	26/06/2012	25/02/2016	104,28%	-
BTAN	1,75%	25/02/2012	21/06/2012	4 345 000 000	26/06/2012	25/02/2017	101,42%	-
<b>TOTAL BTAN</b>				<b>10 102 000 000</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	04/06/2012	12	3 865	07/06/2012	30/08/2012	0,082
BTF	04/06/2012	25	1 999	07/06/2012	29/11/2012	0,115
BTF	04/06/2012	52	1 998	07/06/2012	30/05/2013	0,178
BTF	11/06/2012	13	4 519	14/06/2012	13/09/2012	0,075
BTF	11/06/2012	24	1 796	14/06/2012	29/11/2012	0,129
BTF	11/06/2012	50	1 370	14/06/2012	30/05/2013	0,214
BTF	18/06/2012	5	937	21/06/2012	26/07/2012	0,049
BTF	18/06/2012	12	4 870	21/06/2012	13/09/2012	0,058
BTF	18/06/2012	23	1 698	21/06/2012	29/11/2012	0,094
BTF	18/06/2012	49	1 581	21/06/2012	30/05/2013	0,190
BTF	25/06/2012	13	4 695	28/06/2012	27/09/2012	0,056
BTF	25/06/2012	22	1 534	28/06/2012	29/11/2012	0,104
BTF	25/06/2012	52	2 196	28/06/2012	27/06/2013	0,177
<b>TOTAL BTF</b>			<b>33 058</b>			

► **Rachats de gré à gré :**

**Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat :** **2 950 000 000 €**

OATei 3,00% 25 juillet 2012	2 250 000 000 €
BTAN 4,50% 12 juillet 2013	450 000 000 €
OATi 2,50% 25 juillet 2013	50 000 000 €
BTAN 2,00% 25 septembre 2013 :	200 000 000 €

► <b>Repo et dépôt</b>	au 30 juin 2012		en moyenne sur le mois de juin 2012	
	Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	-		330 230 618,67
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la	Interbancaire		Zone euro	Total
Encours fin de mois	23 850 000 000,00		-	23 850 000 000,00
Encours moyen	12 210 000 000,00		-	12 210 000 000,00

► <b>Billets de trésorerie ACOSS souscrits</b>	au 30 juin 2012		en moyenne sur le mois de juin 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 30 juin 2012 : 7 ans et 4 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er juin 2012**

Aux OATi : 124,63  
Aux OATei : 115,03