

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Septembre 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 | 06/09/2012 | 1 747 000 000 | 11/09/2012 | 25/10/2017 | 115,84% | - |
| OAT | 3,00% | 25/04/2012 | 06/09/2012 | 3 907 000 000 | 11/09/2012 | 25/04/2022 | 106,73% | - |
| OAT | 2,75% | 25/10/2011 | 06/09/2012 | 3 796 000 000 | 11/09/2012 | 25/10/2027 | 98,82% | - |
| OATei | 1,10% | 25/07/2012 | 20/09/2012 | 963 000 000 | 25/09/2012 | 25/07/2022 | 107,96% | 1,06191 |
| OATei | 1,85% | 25/07/2012 | 20/09/2012 | 524 000 000 | 25/09/2012 | 25/07/2027 | 116,63% | 1,04647 |
| OATi | 3,40% | 25/07/2012 | 20/09/2012 | 218 000 000 | 25/09/2012 | 25/07/2029 | 144,36% | 1,23590 |
| OATei | 3,15% | 25/07/2012 | 20/09/2012 | 257 000 000 | 25/09/2012 | 25/07/2032 | 143,87% | 1,21031 |
| TOTAL OAT | | | | 11 412 000 000 | | | | |

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% | 25/09/2012 | 20/09/2012 | 3 262 000 000 | 25/09/2012 | 25/09/2014 | 101,09% | - |
| BTAN | 2,25% | 25/02/2012 | 20/09/2012 | 1 367 000 000 | 25/09/2012 | 25/02/2016 | 105,81% | - |
| BTAN | 1,00% | 25/07/2012 | 20/09/2012 | 3 895 000 000 | 25/09/2012 | 25/07/2017 | 100,09% | - |
| TOTAL BTAN | | | | 8 524 000 000 | | | | |

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 | 03/09/2012 | 13 | 4 283 | 06/09/2012 | 06/12/2012 | -0,014 |
| BTF | 03/09/2012 | 24 | 1 611 | 06/09/2012 | 21/02/2013 | -0,008 |
| BTF | 03/09/2012 | 50 | 1 215 | 06/09/2012 | 22/08/2013 | 0,002 |
| BTF | 10/09/2012 | 12 | 3 999 | 13/09/2012 | 06/12/2012 | -0,021 |
| BTF | 10/09/2012 | 23 | 1 594 | 13/09/2012 | 21/02/2013 | -0,008 |
| BTF | 10/09/2012 | 49 | 1 392 | 13/09/2012 | 22/08/2013 | 0,004 |
| BTF | 17/09/2012 | 13 | 3 798 | 20/09/2012 | 20/12/2012 | -0,012 |
| BTF | 17/09/2012 | 22 | 1 392 | 20/09/2012 | 21/02/2013 | -0,004 |
| BTF | 17/09/2012 | 52 | 1 748 | 20/09/2012 | 19/09/2013 | 0,029 |
| BTF | 24/09/2012 | 13 | 3 798 | 27/09/2012 | 20/12/2012 | -0,016 |
| BTF | 24/09/2012 | 25 | 1 720 | 27/09/2012 | 21/03/2013 | -0,006 |
| BTF | 24/09/2012 | 51 | 1 269 | 27/09/2012 | 19/09/2013 | 0,006 |
| TOTAL BTF | | | 27 819 | | | |

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : **3 503 000 000 €**

| | |
|--------------------------------|-----------------|
| BTAN 3,75% 12 janvier 2013 | 525 000 000 € |
| BTAN 4,50% 12 juillet 2013 | 1 005 000 000 € |
| OATi 2,50% 25 juillet 2013 | 50 000 000 € |
| BTAN 2,00% 25 septembre 2013 : | 213 000 000 € |
| OAT 4,00% 25 octobre 2013 | 1 280 000 000 € |
| BTAN 2,50% 12 janvier 2014 : | 170 000 000 € |
| OAT 4,00% 25 avril 2014 | 260 000 000 € |

► **Repo et dépôt**

| | au 30 septembre 2012 | en moyenne sur le mois de septembre 2012 | |
|--------------------------------------------------------------------|----------------------|------------------------------------------|-------------------|
| Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées | 5 660 463 041,32 | 3 765 973 618,15 | |
| Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la | Interbancaire | Zone euro | Total |
| Encours fin de mois | 17 350 000 000,00 | - | 17 350 000 000,00 |
| Encours moyen | 7 226 333 333,33 | - | 7 226 333 333,33 |

► **Billets de trésorerie ACOSS souscrits**

| | au 30 septembre 2012 | en moyenne sur le mois de septembre 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 septembre 2012 : 7 ans et 27 jours

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

Aux OATi : 124,78
Aux OATei : 115,29