

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Octobre 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	04/10/2012	1 467 000 000	09/10/2012	25/10/2018	117,10%	-
OAT	2,25%	25/10/2011	04/10/2012	5 692 000 000	09/10/2012	25/10/2022	99,75%	-
OAT	4,50%	25/04/2012	04/10/2012	2 293 000 000	09/10/2012	25/04/2041	124,67%	-
OATi	0,10%	25/07/2012	18/10/2012	2 095 000 000	23/10/2012	25/07/2021	101,20%	1,00056
TOTAL OAT				11 547 000 000				

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	18/10/2012	1 003 000 000	23/10/2012	25/09/2014	101,07%	-
BTAN	2,00%	12/07/2012	18/10/2012	1 452 000 000	23/10/2012	12/07/2015	104,49%	-
BTAN	2,50%	25/07/2012	18/10/2012	918 000 000	23/10/2012	25/07/2016	106,98%	-
BTAN	1,00%	25/07/2012	18/10/2012	6 090 000 000	23/10/2012	25/07/2017	100,35%	-
TOTAL BTAN				9 463 000 000				

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	01/10/2012	13	4 128	04/10/2012	03/01/2013	-0,017
BTF	01/10/2012	24	1 693	04/10/2012	21/03/2013	-0,009
BTF	01/10/2012	50	1 295	04/10/2012	19/09/2013	0,025
BTF	08/10/2012	12	3 796	11/10/2012	03/01/2013	-0,018
BTF	08/10/2012	23	1 595	11/10/2012	21/03/2013	-0,010
BTF	08/10/2012	49	1 718	11/10/2012	19/09/2013	0,018
BTF	15/10/2012	13	4 061	18/10/2012	17/01/2013	-0,023
BTF	15/10/2012	22	1 197	18/10/2012	21/03/2013	-0,007
BTF	15/10/2012	52	1 798	18/10/2012	17/10/2013	0,016
BTF	22/10/2012	12	3 973	25/10/2012	17/01/2013	-0,027
BTF	22/10/2012	25	1 760	25/10/2012	18/04/2013	-0,011
BTF	22/10/2012	51	1 443	25/10/2012	17/10/2013	0,022
BTF	29/10/2012	13	3 995	31/10/2012	31/01/2013	-0,022
BTF	29/10/2012	24	1 594	31/10/2012	18/04/2013	-0,012
BTF	29/10/2012	50	1 191	31/10/2012	17/10/2013	0,015
TOTAL BTF			35 237			

► Rachats de gré à gré :
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 2 538 273 470 €

OAT 8,50% 26 décembre 2012	4 573 470 €
BTAN 3,75% 12 janvier 2013	213 000 000 €
OAT 4,00% 25 avril 2013	86 250 000 €
OATi 2,50% 25 juillet 2013	9 200 000 €
BTAN 2,00% 25 septembre 2013	200 000 000 €
OAT 4,00% 25 octobre 2013	347 600 000 €
BTAN 2,50% 12 janvier 2014	1 135 000 000 €
OAT 4% 25 avril 2014	392 650 000 €
BTAN 3,00% 12 juillet 2014	150 000 000 €

► Repo et dépôt

	au 31 octobre 2012	en moyenne sur le mois d'octobre 2012	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	7 461 916 363,84	9 979 286 416,47	
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la	Interbancaire	Zone euro	Total
Encours fin de mois	12 100 000 000,00	-	12 100 000 000,00
Encours moyen	4 935 483 870,97	-	4 935 483 870,97

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits

	au 31 octobre 2012	en moyenne sur le mois d'octobre 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 octobre 2012 : 7 ans et 56 jours
► Références d'inflation applicables au 1er octobre 2012
Aux OATi : 124,22
Aux OATei : 114,65