

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) novembre 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	31/10/2012	1 766 000 000	06/11/2012	25/04/2019	117,55%	-
OAT	2,25%	25/10/2012	31/10/2012	4 925 000 000	06/11/2012	25/10/2022	100,26%	-
OAT	4,75%	25/04/2012	31/10/2012	2 094 000 000	06/11/2012	25/04/2035	127,58%	-
OAT	3,50%	25/04/2012	15/11/2012	2 135 000 000	20/11/2012	25/04/2015	108,08%	-
OATei	1,10%	25/07/2012	15/11/2012	525 000 000	20/11/2012	25/07/2022	108,58%	1,069990
OATei	1,85%	25/07/2012	15/11/2012	335 000 000	20/11/2012	25/07/2027	117,44%	1,054430
TOTAL OAT				11 780 000 000				

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	15/11/2012	2 568 000 000	20/11/2012	25/09/2014	101,20%	-
BTAN	1,00%	25/07/2012	15/11/2012	3 544 000 000	20/11/2012	25/07/2017	101,09%	-
BTANi	0,45%	25/07/2012	15/11/2012	624 000 000	20/11/2012	25/07/2016	105,52%	1,040410
TOTAL BTAN				6 736 000 000				

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	05/11/2012	12	3 792	08/11/2012	31/01/2013	-0,014
BTF	05/11/2012	23	1 596	08/11/2012	18/04/2013	-0,007
BTF	05/11/2012	49	1 397	08/11/2012	17/10/2013	0,019
BTF	12/11/2012	13	3 996	15/11/2012	14/02/2013	-0,014
BTF	12/11/2012	22	1 340	15/11/2012	18/04/2013	-0,002
BTF	12/11/2012	48	1 301	15/11/2012	17/10/2013	0,019
BTF	19/11/2012	12	3 997	22/11/2012	14/02/2013	-0,016
BTF	19/11/2012	21	1 391	22/11/2012	18/04/2013	-0,009
BTF	19/11/2012	51	1 656	22/11/2012	14/11/2013	0,026
BTF	26/11/2012	13	3 999	29/11/2012	28/02/2013	-0,020
BTF	26/11/2012	24	1 591	29/11/2012	16/05/2013	-0,010
BTF	26/11/2012	50	1 290	29/11/2012	14/11/2013	0,019
TOTAL BTF			27 346			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : **1 200 000 000 €**

BTAN 2,50% 12 janvier 2014	950 000 000 €
OAT 4% 25 avril 2014	150 000 000 €
BTAN 3,00% 12 juillet 2014	100 000 000 €

► Repo et dépôt	au 30 novembre 2012	en moyenne sur le mois de novembre 2012	
	Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	11 930 186 191,16	12 430 453 772,73
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la	Interbancaire	Zone euro	Total
Encours fin de mois	9 850 000 000,00	-	9 850 000 000,00
Encours moyen	5 636 333 333,33	-	5 636 333 333,33

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 30 novembre 2012	en moyenne sur le mois de novembre 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 novembre 2012 : 7 ans et 40 jours

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

Aux OATi :	125,06
Aux OATei :	115,10