



Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Janvier 2014

► Adjudications moyen et long terme

| Type d'obligation | Taux du coupon | Date de jouissance | Date d'adjudication | Montant émis (en M d'euros) | Date de règlement | Date d'échéance | Prix moyen pondéré | Coefficient d'indexation |
|-------------------|----------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------|
| OAT | 2,50% | 25/10/2013 | 09/01/2014 | 1 845 | 13/01/2014 | 25/10/2020 | 105,26% | - |
| OAT | 2,25% | 25/05/2013 | 09/01/2014 | 6 175 | 13/01/2014 | 25/05/2024 | 97,61% | - |
| OAT | 4,00% | 25/04/2013 | 09/01/2014 | 1 805 | 13/01/2014 | 25/04/2060 | 110,62% | - |
| OAT | 3,25% | 25/04/2013 | 23/01/2014 | 2 482 | 28/01/2014 | 25/04/2016 | 106,47% | - |
| OAT | 1,00% | 25/05/2013 | 23/01/2014 | 2 448 | 28/01/2014 | 25/05/2018 | 100,27% | - |
| OAT | 1,00% | 25/05/2013 | 23/01/2014 | 4 593 | 28/01/2014 | 25/05/2019 | 98,76% | - |
| BTANi | 0,45% | 25/07/2013 | 23/01/2014 | 786 | 28/01/2014 | 25/07/2016 | 103,31% | 1,04482 |
| OATei | 0,25% | 25/07/2013 | 23/01/2014 | 747 | 28/01/2014 | 25/07/2018 | 102,02% | 1,03664 |
| OATei | 0,25% | 25/07/2013 | 23/01/2014 | 415 | 28/01/2014 | 25/07/2024 | 94,92% | 1,01258 |
| TOTAL OAT | | | | 21 296 | | | | |

► Adjudications court terme

| Type d'obligation | Date d'adjudication | Durée (en semaines) | Montant (en M d'euros) | Date de règlement | Date d'échéance | Taux moyen pondéré (%) |
|-------------------|---------------------|---------------------|------------------------|-------------------|-----------------|------------------------|
| BTF | 6/1/14 | 13 | 4 494 | 09/01/2014 | 10/04/2014 | 0,081% |
| BTF | 6/1/14 | 22 | 1 997 | 09/01/2014 | 12/06/2014 | 0,122% |
| BTF | 6/1/14 | 52 | 1 999 | 09/01/2014 | 08/01/2015 | 0,162% |
| BTF | 13/1/14 | 12 | 4 496 | 16/01/2014 | 10/04/2014 | 0,105% |
| BTF | 13/1/14 | 21 | 2 197 | 16/01/2014 | 12/06/2014 | 0,136% |
| BTF | 13/1/14 | 51 | 2 202 | 16/01/2014 | 08/01/2015 | 0,166% |
| BTF | 20/1/14 | 13 | 5 123 | 23/01/2014 | 24/04/2014 | 0,173% |
| BTF | 20/1/14 | 20 | 2 395 | 23/01/2014 | 12/06/2014 | 0,173% |
| BTF | 20/1/14 | 50 | 2 444 | 23/01/2014 | 08/01/2015 | 0,192% |
| BTF | 27/1/14 | 12 | 4 282 | 30/01/2014 | 24/04/2014 | 0,156% |
| BTF | 27/1/14 | 23 | 2 235 | 30/01/2014 | 10/07/2014 | 0,176% |
| BTF | 27/1/14 | 49 | 2 212 | 30/01/2014 | 08/01/2015 | 0,190% |
| TOTAL BTF | | | 36 076 | | | |

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : **100 000 000 €**

OAT 3,50% 25 avril 2015

100 000 000 €

| ► Repo et dépôt | au 31 janvier 2014 | en moyenne sur le mois de janvier 2014 | |
|---|--------------------|--|-------------------|
| Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées | 3 599 729 900,60 | 1 753 439 352,13 | |
| Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro et auprès des Etats de cette même zone | Interbancaire | Zone euro | Total |
| Encours fin de mois | 11 742 000 000,00 | - | 11 742 000 000,00 |
| Encours moyen | 9 197 129 032,26 | 774 193 548,39 | 9 971 322 580,65 |
| Encours des emprunts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro et auprès des Etats de cette même zone | Interbancaire | Zone euro | Total |
| Encours fin de mois | - | - | - |
| Encours moyen | - | 32 258 064,52 | 32 258 064,52 |

| ► Billets de trésorerie ACOSS souscrits | au 31 janvier 2014 | en moyenne sur le mois de janvier 2014 |
|--|--------------------|--|
| | - | 703 225 806,45 |

► **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 janvier 2014 : 7 ans et 33 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er janvier 2014**

Aux OATi : 125,44

Aux OAT€i : 116,96

