

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Février 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 | 2,25% | 25/05/2013 | 06/02/2014 | 4 725 | 11/02/2014 | 25/05/2024 | 99,96% | - |
| OAT | 2,75% | 25/10/2013 | 06/02/2014 | 3 587 | 11/02/2014 | 25/10/2027 | 100,99% | - |
| OAT | 5,75% | 25/10/2013 | 06/02/2014 | 1 249 | 11/02/2014 | 25/10/2032 | 141,05% | - |
| BTAN | 2,50% | 25/07/2013 | 20/02/2014 | 2 603 | 25/02/2014 | 25/07/2016 | 105,31% | - |
| OAT | 4,25% | 25/10/2013 | 20/02/2014 | 1 370 | 25/02/2014 | 25/10/2017 | 113,30% | - |
| OAT | 1,00% | 25/05/2013 | 20/02/2014 | 4 010 | 25/02/2014 | 25/05/2019 | 99,70% | - |
| OATei | 0,25% | 25/07/2013 | 20/02/2014 | 746 | 25/02/2014 | 25/07/2018 | 102,01% | 1,03972 |
| OATei | 0,25% | 25/07/2013 | 20/02/2014 | 482 | 25/02/2014 | 25/07/2024 | 95,26% | 1,01559 |
| OATi | 3,40% | 25/07/2013 | 20/02/2014 | 324 | 25/02/2014 | 25/07/2029 | 136,00% | 1,25007 |
| TOTAL OAT | | | | 19 096 | | | | |

► 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 | 3/2/14 | 13 | 4 051 | 6/2/14 | 7/5/14 | 0,131% |
| BTF | 3/2/14 | 22 | 2 115 | 6/2/14 | 10/7/14 | 0,136% |
| BTF | 3/2/14 | 52 | 2 252 | 6/2/14 | 5/2/15 | 0,150% |
| BTF | 10/2/14 | 12 | 4 090 | 13/2/14 | 7/5/14 | 0,151% |
| BTF | 10/2/14 | 21 | 2 042 | 13/2/14 | 10/7/14 | 0,157% |
| BTF | 10/2/14 | 51 | 1 992 | 13/2/14 | 5/2/15 | 0,162% |
| BTF | 17/2/14 | 13 | 4 688 | 20/2/14 | 22/5/14 | 0,149% |
| BTF | 17/2/14 | 20 | 2 258 | 20/2/14 | 10/7/14 | 0,151% |
| BTF | 17/2/14 | 50 | 2 226 | 20/2/14 | 5/2/15 | 0,158% |
| BTF | 24/2/14 | 12 | 4 506 | 27/2/14 | 22/5/14 | 0,139% |
| BTF | 24/2/14 | 23 | 2 306 | 27/2/14 | 7/8/14 | 0,153% |
| BTF | 24/2/14 | 49 | 1 706 | 27/2/14 | 5/2/15 | 0,155% |
| TOTAL BTF | | | 34 232 | | | |

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : **1 235 000 000 €**

| | |
|-----------------------------|---------------|
| BTAN 2,50% 15 janvier 2015 | 385 000 000 € |
| OAT 3,50% 25 avril 2015 | 150 000 000 € |
| BTAN 2,00% 12 juillet 2015 | 250 000 000 € |
| OATei 1,60% 25 juillet 2015 | 450 000 000 € |

► **Repo et dépôt**

| | au 28 février 2014 | en moyenne sur le mois de février 2014 | |
|---|--------------------|--|-------------------|
| Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées | 12 050 228 465,45 | 5 962 489 029,70 | |
| 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 | 14 956 000 000,00 | - | 14 956 000 000,00 |
| Encours moyen | 8 620 214 285,71 | - | 8 620 214 285,71 |
| 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 | - | 446 428 571,43 | 446 428 571,43 |

► **Billets de trésorerie ACOSS souscrits**

| | au 28 février 2014 | en moyenne sur le mois de février 2014 |
|--|--------------------|--|
| | - | - |

► **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 28 février 2014 : **7 ans et 10 jours**

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

Aux OATi : 125,38
Aux OAT€i : 116,86