

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

juin 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	3,00%	25/04/2014	05/06/2014	968	10/06/2014	25/04/2022	111,98%	-
OAT	1,75%	25/11/2013	05/06/2014	6 447	10/06/2014	25/11/2024	98,01%	-
OAT	2,50%	25/05/2014	05/06/2014	2 792	10/06/2014	25/05/2030	99,54%	-
OAT	0,25%	25/11/2013	19/06/2014	4 094	24/06/2014	25/11/2016	100,32%	-
OAT	0,50%	25/11/2013	19/06/2014	4 396	24/06/2014	25/11/2019	99,02%	-
TOTAL OAT				18 697				

► OAT syndication

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date de syndication	Montant émis (en M d'euros)	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
OATei	0,70%	25/07/2013	11/06/2014	3 500	18/06/2014	25/07/2030	99,09%	1,004870
TOTAL OAT				3 500				

► 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	2/6/14	12	4 035	05/06/14	28/08/14	0,116%
BTF	2/6/14	21	1 971	05/06/14	30/10/14	0,107%
BTF	2/6/14	51	1 944	05/06/14	28/05/15	0,108%
BTF	10/6/14	13	4 521	12/06/14	11/09/14	0,081%
BTF	10/6/14	20	2 080	12/06/14	30/10/14	0,079%
BTF	10/6/14	50	1 935	12/06/14	28/05/15	0,081%
BTF	16/6/14	12	3 994	19/06/14	11/09/14	0,001%
BTF	16/6/14	23	1 798	19/06/14	27/11/14	0,003%
BTF	16/6/14	49	1 520	19/06/14	28/05/15	0,025%
BTF	23/6/14	13	4 157	26/06/14	25/09/14	0,020%
BTF	23/6/14	22	1 706	26/06/14	27/11/14	0,027%
BTF	23/6/14	52	1 810	26/06/14	25/06/15	0,040%
BTF	30/6/14	12	4 397	03/07/14	25/09/14	0,018%
BTF	30/6/14	21	1 777	03/07/14	27/11/14	0,020%
BTF	30/6/14	51	1 949	03/07/14	25/06/15	0,040%
TOTAL BTF			39 594			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat :

5 015 000 000 €

BTAN 2,50% 25 janvier 2015	50 000 000 €
OAT 3,50% 25 avril 2015	340 000 000 €
BTAN 2,00% 12 juillet 2015	2 035 000 000 €
OATei 1,60% 25 juillet 2015	490 000 000 €
OAT 3,00% 25 octobre 2015	1 400 000 000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2015	300 000 000 €
BTAN 2,25% février 2016	400 000 000 €

► **Repo et dépôt**

Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	au 30 juin 2014	en moyenne sur le mois de juin 2014
Prises en pensions	19 690 703 851,44	18 456 927 988,28
Mises en pensions	-	2 766 866,67

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	25 000 000 000,00	-	25 000 000 000,00
Encours moyen	10 757 400 000,00	-	10 757 400 000,00
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	-	-	0,00
Encours moyen	-	-	0,00

Encours des billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 30 juin 2014	en moyenne sur le mois de juin 2014
	8 000 000 000,00	2 506 666 666,67

► **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 juin 2014 : 6 ans et 341 jours

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

Aux OATi : 126,29

Aux OAT€i : 117,39