

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



AGENCE
FRANCE TRÉSOR

► 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	1.75%	25/11/2013	03/07/2014	3,567	08/07/2014	25/11/2024	99.85%	-
OAT	2.75%	25/10/2013	03/07/2014	3,378	08/07/2014	25/10/2027	107.15%	-
OAT	2.50%	25/05/2014	03/07/2014	3,258	08/07/2014	25/05/2030	101.57%	-
OAT	0.25%	25/11/2013	17/07/2014	3,192	22/07/2014	25/11/2016	100.38%	-
OAT	4.00%	25/04/2014	17/07/2014	1,330	22/07/2014	25/04/2018	114.14%	-
OAT	0.50%	25/11/2013	17/07/2014	3,940	22/07/2014	25/11/2019	99.73%	-
OATei	0.25%	25/07/2013	17/07/2014	690	22/07/2014	25/07/2018	103.66%	1.04204
OATi	0.10%	25/07/2013	17/07/2014	350	22/07/2014	25/07/2021	103.43%	1.01214
OATei	0.25%	25/07/2013	17/07/2014	546	22/07/2014	25/07/2024	102.54%	1.01786
TOTAL OAT				20,251				

► 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	7/7/14	13	4,350	10/7/14	9/10/14	0.016%
BTF	7/7/14	20	2,039	10/7/14	27/11/14	0.021%
BTF	7/7/14	50	1,938	10/7/14	25/6/15	0.029%
BTF	15/7/14	12	4,557	17/7/14	9/10/14	0.013%
BTF	15/7/14	23	2,202	17/7/14	24/12/14	0.013%
BTF	15/7/14	49	1,882	17/7/14	25/6/15	0.029%
BTF	21/7/14	13	4,385	24/7/14	23/10/14	0.013%
BTF	21/7/14	22	1,911	24/7/14	24/12/14	0.016%
BTF	21/7/14	52	1,835	24/7/14	23/7/15	0.022%
BTF	28/7/14	12	4,420	31/7/14	23/10/14	0.012%
BTF	28/7/14	21	1,919	31/7/14	24/12/14	0.017%
BTF	28/7/14	51	1,818	31/7/14	23/7/15	0.022%
TOTAL BTF			33,256			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 1,955,000,000 €

BTAN 2,50% 12 janvier 2015	170,000,000 €
BTAN 2,00% 12 juillet 2015	600,000,000 €
OATei 1,60% 25 juillet 2015	725,000,000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2015	250,000,000 €
BTAN 2,25% février 2016	210,000,000 €

► **Repo et dépôt**

Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	au 31 juillet 2014	en moyenne sur le mois de juillet 2014
Prises en pensions	18,299,941,200.68	22,417,059,718.64
Mises en pensions	-	-

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	9,271,000,000.00	-	9,271,000,000.00
Encours moyen	7,744,451,613.55	96,774,193.55	7,841,225,807.10
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 31 juillet 2014	en moyenne sur le mois de juillet 2014
	-	2,854,838,709.68

► **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 juillet 2014 : 7 ans et 9 jours

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

Aux OATi : 126,24

Aux OAT€i : 117,57