

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) septembre 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	1,75%	25/11/2013	04/09/2014	5 440	09/09/2014	25/11/2024	104,08%	-
OAT	2,50%	25/05/2014	04/09/2014	4 195	09/09/2014	25/05/2030	107,79%	-
OAT	3,25%	25/05/2014	04/09/2014	1 150	09/09/2014	25/05/2045	118,99%	-
OAT	0,25%	25/11/2013	18/09/2014	2 795	23/09/2014	25/11/2016	100,53%	-
OAT	1,00%	25/05/2014	18/09/2014	1 550	23/09/2014	25/05/2019	103,25%	-
OAT	0,50%	25/11/2013	18/09/2014	5 045	23/09/2014	25/11/2019	100,55%	-
OATei	0,25%	25/07/2014	18/09/2014	449	23/09/2014	25/07/2018	104,16%	1,03768
OATi	0,10%	25/07/2014	18/09/2014	785	23/09/2014	25/07/2021	103,86%	1,00941
OATei	0,25%	25/07/2014	18/09/2014	490	23/09/2014	25/07/2024	102,84%	1,01360
TOTAL OAT				21 899				

► 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	1/9/14	13	3 991	4/9/14	3/12/14	-0,004%
BTF	1/9/14	20	2 093	4/9/14	22/1/15	-0,003%
BTF	1/9/14	50	2 195	4/9/14	20/8/15	-0,002%
BTF	8/9/14	12	4 228	11/9/14	3/12/14	-0,054%
BTF	8/9/14	23	1 971	11/8/14	18/2/15	-0,055%
BTF	8/9/14	49	1 986	11/9/14	20/8/15	-0,057%
BTF	15/9/14	13	4 196	18/9/14	17/12/14	-0,051%
BTF	15/9/14	22	1 794	18/9/14	18/2/15	-0,048%
BTF	15/9/14	52	1 996	18/9/14	16/9/15	-0,047%
BTF	22/9/14	12	4 195	25/9/14	17/12/14	-0,036%
BTF	22/9/14	21	1 752	25/9/14	18/2/15	-0,035%
BTF	22/9/14	51	1 691	25/9/14	16/9/15	-0,034%
BTF	29/9/14	13	4 085	2/10/14	31/12/14	-0,028%
BTF	29/9/14	20	1 727	2/10/14	18/2/15	-0,032%
BTF	29/9/14	50	1 737	2/10/14	16/9/15	-0,032%
TOTAL BTF			39 637			

► **Rachats de gré à gré :**

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

1 990 000 000 €



**AGENCE
FRANCE TRÉSOR**

OAT 3,50% 25 avril 2015	465 000 000 €
BTAN 2,00% 12 juillet 2015	850 000 000 €
OATei 1,60% 25 juillet 2015	450 000 000 €
OAT 3,00% 25 octobre 2015	65 000 000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2015	160 000 000 €

► **Repo et dépôt**

	au 30 septembre 2014	en moyenne sur le mois de septembre 2014
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées		
Prises en pensions	1 001 066 570,00	442 692 802,83
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	18 250 000 000,00	-
Encours moyen	5 601 666 666,67	-	5 601 666 666,67

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	-	200 000 000,00	200 000 000,00

► **Encours des billets de trésorerie ACOSS souscrits**

	au 30 septembre 2014	en moyenne sur le mois de septembre 2014
	-	646 666 666,67

► **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 septembre 2014 : 6 ans et 361 jours

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

Aux OATi : 126,22

Aux OAT€i : 117,57