

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) décembre 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%	25/05/2014	04/12/2014	2,075	08/12/2014	25/05/2023	108.08%	-
OAT	6.00%	25/10/2014	04/12/2014	1,376	08/12/2014	25/10/2025	149.89%	-
OAT	2.75%	25/10/2014	04/12/2014	689	08/12/2014	25/10/2027	115.95%	-
TOTAL OAT				4,140				

► 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	1/12/14	12	3,990	3/12/14	25/2/15	-0.017%
BTF	1/12/14	23	1,903	3/12/14	13/5/15	-0.015%
BTF	1/12/14	49	1,497	3/12/14	11/11/15	-0.007%
BTF	8/12/14	13	3,993	10/12/14	11/3/15	-0.013%
BTF	8/12/14	22	1,540	10/12/14	13/5/15	-0.009%
BTF	8/12/14	52	2,002	10/12/14	9/12/15	-0.006%
BTF	15/12/14	12	3,955	17/12/14	11/3/15	-0.007%
BTF	15/12/14	21	1,454	17/12/14	13/5/15	-0.007%
BTF	15/12/14	51	1,750	17/12/14	9/12/15	-0.005%
BTF	22/12/14	20	1,674	24/12/14	13/5/15	-0.035%
BTF	22/12/14	50	1,195	24/12/14	9/12/15	-0.028%
TOTAL BTF			24,953			



► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 1,884,000,000 €

BTAN 2,00% 12 juillet 2015	150,000,000 €
OAT 3,00% 25 octobre 2015	167,000,000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2015	180,000,000 €
BTAN 2,25% 25 février 2016	150,000,000 €
OAT 3,25% 25 avril 2016	277,000,000 €
BTAN 2,50% 25 juillet 2016	610,000,000 €
BTANi 0,45% 25 juillet 2016	350,000,000 €

► **Repo et dépôt**

Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	au 31 décembre 2014	en moyenne sur le mois de décembre 2014
Prises en pensions	3,399,999,253.11	4,785,328,659.24
Mises en pensions	-	-

Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro et auprès des Etats de cette même zone		Zone euro	Total
		Encours fin de mois	13,070,000,000.00
Encours moyen	4,386,129,032.26	4,386,129,032.26	

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	-	0.00	

Encours des billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 31 décembre 2014	en moyenne sur le mois de décembre 2014
	8,100,000,000.00	2,800,000,000.00

► **Contrats d'échange de taux d'intérêts**

Volume nominal négocié au cours du mois : 1,000,000,000 €

► **Durée de vie moyenne de la dette négociable incluant les opérations d'échange de taux d'intérêt**

Au 31 décembre 2014 : 6 ans et 362 jours

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

Aux OATi : 125,88

Aux OATéi : 117,43