

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros)
Novembre 2015



► **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	1,00%	25/11/2014	05/11/2015	3 146	09/11/2015	25/11/2025	100,50%	-
OAT	3,50%	25/04/2015	05/11/2015	2 330	09/11/2015	25/04/2026	125,14%	-
OAT	1,50%	25/05/2015	05/11/2015	2 520	09/11/2015	25/05/2031	100,13%	-
OAT	4,25%	25/10/2015	19/11/2015	2 900	23/11/2015	25/10/2018	113,22%	-
OAT	0,25%	25/11/2014	19/11/2015	3 405	23/11/2015	25/11/2020	101,21%	-
OAT	2,25%	25/10/2015	19/11/2015	1 670	23/11/2015	25/10/2022	113,54%	-
OATei	0,25%	25/07/2015	19/11/2015	665	23/11/2015	25/07/2024	107,80%	1,015080
OATei	1,85%	25/07/2015	19/11/2015	488	23/11/2015	25/07/2027	126,26%	1,068200
OATei	3,15%	25/07/2015	19/11/2015	534	23/11/2015	25/07/2032	155,19%	1,235440
TOTAL OAT				17 658				

► **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	02/11/2015	12	3 960	04/11/2015	27/01/2016	-0,261%
BTF	02/11/2015	23	1 817	04/11/2015	13/04/2016	-0,256%
BTF	02/11/2015	49	1 811	04/11/2015	12/10/2016	-0,257%
BTF	09/11/2015	13	3 961	11/11/2015	10/02/2016	-0,254%
BTF	09/11/2015	22	1 935	11/11/2015	13/04/2016	-0,256%
BTF	09/11/2015	48	2 126	11/11/2015	12/10/2016	-0,259%
BTF	16/11/2015	12	3 894	18/11/2015	10/02/2016	-0,288%
BTF	16/11/2015	21	1 538	18/11/2015	13/04/2016	-0,278%
BTF	16/11/2015	51	2 036	18/11/2015	09/11/2016	-0,294%
BTF	23/11/2015	13	4 256	25/11/2015	24/02/2016	-0,322%
BTF	23/11/2015	20	1 729	25/11/2015	13/04/2016	-0,318%
BTF	23/11/2015	50	1 915	25/11/2015	09/11/2016	-0,321%
BTF	30/11/2015	12	4 194	02/12/2015	24/02/2016	-0,347%
BTF	30/11/2015	23	1 997	02/12/2015	11/05/2016	-0,354%
BTF	30/11/2015	49	1 593	02/12/2015	09/11/2016	-0,358%
TOTAL BTF			38 762			

► **Rachats de gré à gré :**

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

2 995 500 000 €

BTF 18 novembre 2015	50 000 000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2015	55 000 000 €
BTAN 2,25% 25 février 2016	350 000 000 €
OAT 3,25% 25 avril 2016	497 000 000 €
BTAN 2,50% 25 juillet 2016	408 500 000 €
OAT 5% 25 octobre 2016	200 000 000 €
OAT 0,25% 25 novembre 2016	235 000 000 €
BTAN 1,75% 25 février 2017	675 000 000 €
OAT 3,75% 25 avril 2017	125 000 000 €
BTAN 1,00% 25 juillet 2017	400 000 000 €

► **Repo et dépôt**

Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	au 30 novembre 2015	en moyenne sur le mois de novembre 2015	
Prises en pensions	4 549 999 010,38	4 654 654 169,93	
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	11 950 000 000,00	-	11 950 000 000,00
Encours moyen	7 737 000 000,00	-	7 737 000 000,00
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 novembre 2015	en moyenne sur le mois de novembre 2015	
	-	166 666 666,67	

► **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 novembre 2015 : 7 ans et 47 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er novembre 2015**

Aux OATi : 126,43

Aux OAT€ : 116,97