

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) août 2011

► Adjudications de BTF

Type d'obligation	Date d'adjudication	Durée (en semaines)	Montant (en M d'euros)	Date de règlement	Date d'échéance	Taux moyen pondéré (%)
BTF	01/08/2011	12	4 845	04/08/2011	27/10/2011	0,910
BTF	01/08/2011	25	2 249	04/08/2011	26/01/2012	1,041
BTF	01/08/2011	51	2 232	04/08/2011	26/07/2012	1,210
BTF	08/08/2011	13	4 773	11/08/2011	10/11/2011	0,791
BTF	08/08/2011	28	2 585	11/08/2011	23/02/2012	0,798
BTF	08/08/2011	50	1 071	11/08/2011	26/07/2012	0,840
BTF	16/08/2011	7	2 000	18/08/2011	06/10/2011	0,670
BTF	16/08/2011	12	4 078	18/08/2011	10/11/2011	0,730
BTF	16/08/2011	27	1 656	18/08/2011	23/02/2012	0,792
BTF	22/08/2011	13	4 400	25/08/2011	24/11/2011	0,696
BTF	22/08/2011	26	2 004	25/08/2011	23/02/2012	0,685
BTF	22/08/2011	48	2 013	25/08/2011	26/07/2012	0,710
BTF	29/08/2011	10	1 502	01/09/2011	10/11/2011	0,600
BTF	29/08/2011	12	4 003	01/09/2011	24/11/2011	0,579
BTF	29/08/2011	25	1 503	01/09/2011	23/02/2012	0,667
BTF	29/08/2011	51	1 504	01/09/2011	23/08/2012	0,748
TOTAL BTF			42 418			

► Rachats de gré à gré :
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 5 314 000 000 €

BTAN 3,75% 12 janvier 2012 :	933 000 000 €
OAT 5,00% 25 avril 2012 :	700 000 000 €
BTAN 4,50% 12 juillet 2012 :	380 000 000 €
OATei 3,00% 25 juillet 2012 :	1 148 000 000 €
BTAN 0,75% 20 septembre 2012 :	1 210 000 000 €
OAT 4,75% 25 octobre 2012 :	843 000 000 €
BTAN 3,75% 12 janvier 2013 :	100 000 000 €

► Repo et dépôt

	au 31 août 2011	en moyenne sur le mois d'août 2011	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	4 800 305 531,36	11 900 289 219,46	
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	12 955 000 000,00	-	12 955 000 000,00
Encours moyen	15 081 129 032,26	-	15 081 129 032,26

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits

	au 31 août 2011	en moyenne sur le mois d'août 2011
	-	-

► Contrats d'échange de taux d'intérêts

Volume nominal négocié au cours du mois : 900 000 000,00 €

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

Au 31 août 2011 : 7 ans et 44 jours

► Références d'inflation applicables au 1er août 2011

Aux OATi :	122,4
Aux OATei :	112,74