

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

► Adjudications d'OAT

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date d'adjudication	Montant émis	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
OAT	3,50%	25/04/2011	07/07/2011	2 553 000 000	12/07/2011	25/04/2020	101,61%	-
OAT	3,25%	25/10/2010	07/07/2011	4 655 000 000	12/07/2011	25/10/2021	97,91%	-
OAT	5,50%	25/04/2011	07/07/2011	2 402 000 000	12/07/2011	25/04/2029	119,60%	-
OATei	1,10%	25/07/2011	21/07/2011	701 000 000	26/07/2011	25/07/2022	99,26%	1,043070
OATei	1,80%	25/07/2011	21/07/2011	296 000 000	26/07/2011	25/07/2040	108,31%	1,101250
TOTAL OAT				10 607 000 000				

► Adjudications de BTAN

Type d'obligation	Taux du coupon	Date de jouissance	Date d'adjudication	Montant émis	Date de règlement	Date d'échéance	Prix moyen pondéré	Coefficient d'indexation
BTANi	0,45%	25/07/2011	21/07/2011	646 000 000	26/07/2011	25/07/2016	100,39%	1,019800
BTAN	2,00%	25/09/2010	21/07/2011	2 153 000 000	26/07/2011	25/09/2013	100,85%	-
BTAN	3,00%	12/07/2011	21/07/2011	2 805 000 000	26/07/2011	12/07/2014	103,37%	-
BTAN	2,50%	25/07/2011	21/07/2011	3 363 000 000	26/07/2011	25/07/2016	99,92%	-
TOTAL BTAN				8 967 000 000				

► 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	04/07/2011	12	5 026	07/07/2011	29/09/2011	1,171
BTF	04/07/2011	25	1 085	07/07/2011	29/12/2011	1,293
BTF	04/07/2011	51	2 644	07/07/2011	28/06/2012	1,483
BTF	11/07/2011	10	1 523	13/07/2011	22/09/2011	1,015
BTF	11/07/2011	13	4 085	13/07/2011	13/10/2011	1,074
BTF	11/07/2011	16	1 049	13/07/2011	03/11/2011	1,170
BTF	11/07/2011	28	2 564	13/07/2011	26/01/2012	1,210
BTF	18/07/2011	12	4 004	21/07/2011	13/10/2011	1,046
BTF	18/07/2011	19	1 016	21/07/2011	01/12/2011	1,088
BTF	18/07/2011	27	1 581	21/07/2011	26/01/2012	1,174
BTF	18/07/2011	49	1 504	21/07/2011	28/06/2012	1,184
BTF	25/07/2011	13	5 011	28/07/2011	27/10/2011	1,116
BTF	25/07/2011	26	2 212	28/07/2011	26/01/2012	1,183
BTF	25/07/2011	48	1 661	28/07/2011	28/06/2012	1,326
TOTAL BTF			34 965			

► Rachats de gré à gré :
Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 5 210 000 000 €

BTAN 3,75% 12 janvier 2012 :	1 100 000 000 €
OAT 5,00% 25 avril 2012 :	1 050 000 000 €
OATei 3,00% 25 juillet 2012 :	300 000 000 €
BTAN 4,50% 12 juillet 2012 :	2 190 000 000 €
BTAN 0,75% 20 septembre 2012 :	370 000 000 €
OAT 4,75% 25 octobre 2012 :	200 000 000 €

► Repo et dépôt	au 31 juillet 2011	en moyenne sur le mois de juillet 2011	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	20 000 356 418,33	36 663 148 244,94	
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	16 325 000 000,00	-	16 325 000 000,00
Encours moyen	15 602 903 225,81		15 602 903 225,81

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 31 juillet 2011	en moyenne sur le mois de juillet 2011
	-	-

► 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 2011 : 7 ans et 71 jours

► Références d'inflation applicables au 1er juillet 2011

 Aux OATi : 122,32
 Aux OATei : 112,75