

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) septembre 2007



AGENCE
FRANCE TRÉSOR

► 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	4,25%	25/10/2006	06/09/2007	4 506 000 000	11/09/2007	25 October 2017	99,17%	-
OAT	5,00%	25/04/2007	20/09/2007	1 515 000 000	25/09/2007	25 April 2012	103,29%	-
OATi	1,00%	25/07/2007	20/09/2007	591 000 000	25/09/2007	25 July 2017	89,24%	1,031320
OAT€	1,80%	25/07/2007	20/09/2007	347 000 000	25/09/2007	25 July 2040	89,72%	1,017750
TOTAL OAT				6 959 000 000				

► Adjudication 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
BTAN	4,00%	12/09/2007	20/09/2007	1 500 000 000	25/09/2007	12 September 2009	99,80%	-
TOTAL BTAN				1 500 000 000				

► 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	03/09/2007	12	1 801	06/09/2007	29/11/2007	3,924
BTF	03/09/2007	47	1 404	06/09/2007	31/07/2008	4,075
BTF	10/09/2007	13	1 822	13/09/2007	13/12/2007	3,967
BTF	10/09/2007	50	1 400	13/09/2007	28/08/2008	3,984
BTF	17/09/2007	12	2 101	20/09/2007	13/12/2007	3,919
BTF	17/09/2007	23	1 420	20/09/2007	28/02/2008	3,999
BTF	24/09/2007	12	2 253	27/09/2007	20/12/2007	3,912
BTF	24/09/2007	48	1 503	27/09/2007	28/08/2008	4,002
TOTAL BTF			13 704			

► **Rachats de gré à gré :**

BTAN 3,50% 12 janvier 2008 : 130 000 000 €

BTAN 2,75% 12 mars 2008 : 425 000 000 €

TOTAL RACHATS : 555 000 000 €

► **Repo et dépôt**

	au 30 septembre 2007	en moyenne sur le mois de septembre 2007
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	22 302 122 949,74	8 923 931 400,40
Encours des dépôts de liquidités sur le marché interbancaire de la zone euro et auprès des États de cette même zone	4 740 000 000,00	4 244 333 333,33

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

Volume nominal négocié au cours du mois : 1 050 000 000 €

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

Au 30 septembre 2007 : 7 ans et 14 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er septembre 2007**

Aux OATi : 114,90

Aux OAT€ : 104,41