

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Septembre 2009

► 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	3,00%	25/10/2008	03/09/2009	2 265 000 000	08/09/2009	25/10/2015	100,89%	-
OAT	3,75%	25/10/2008	03/09/2009	3 540 000 000	08/09/2009	25/10/2019	101,55%	-
OAT	4,25%	25/10/2008	03/09/2009	1 660 000 000	08/09/2009	25/10/2023	103,68%	-
OAT	5,00%	25/04/2009	17/09/2009	1 812 000 000	22/09/2009	25/04/2012	108,34%	-
OATEei	1,60%	25/07/2009	17/09/2009	699 000 000	22/09/2009	25/07/2015	103,91%	1,098740
OATi	1,00%	25/07/2009	17/09/2009	699 000 000	22/09/2009	25/07/2017	98,87%	1,061000
OATei	3,15%	25/07/2009	17/09/2009	370 000 000	22/09/2009	25/07/2032	125,56%	1,136080
TOTAL OAT				11 045 000 000				

► 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
BTAN	1,50%	12/09/2009	17/09/2009	3 566 000 000	22/09/2009	12/09/2011	100,34%	-
BTAN	3,00%	12/07/2009	17/09/2009	3 236 000 000	22/09/2009	12/07/2014	101,76%	-
TOTAL BTAN				6 802 000 000				

► 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	07/09/2009	9	1 521	10/09/2009	12/11/2009	0,313
BTF	07/09/2009	13	4 235	10/09/2009	10/12/2009	0,339
BTF	07/09/2009	24	2 108	10/09/09	25/02/2010	0,394
BTF	07/09/2009	50	2 181	10/09/09	26/08/2010	0,595
BTF	14/09/2009	9	1 515	17/09/2009	19/11/2009	0,335
BTF	14/09/2009	12	3 549	17/09/2009	10/12/2009	0,354
BTF	14/09/2009	21	2 025	17/09/2009	11/02/2010	0,419
BTF	14/09/2009	49	2 007	17/09/2009	26/08/2010	0,635
BTF	21/09/2009	9	1 568	24/09/2009	26/11/2009	0,347
BTF	21/09/2009	13	4 330	24/09/2009	24/12/2009	0,381
BTF	21/09/2009	22	2 228	24/09/2009	25/02/2010	0,447
BTF	21/09/2009	52	1 682	24/09/2009	23/09/2010	0,704
BTF	28/09/2009	5	2 071	01/10/2009	05/11/2009	0,324
BTF	28/09/2009	12	3 506	01/10/2009	24/12/2009	0,375
BTF	28/09/2009	25	2 067	01/10/2009	25/03/2010	0,459
BTF	28/09/2009	51	1 573	01/10/2009	23/09/2010	0,687
TOTAL BTF			38 166			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 2 350 000 000 €

BTAN 3,75% 12 septembre 2010 : 350 000 000 €

BTAN€ 1,25% 25 juillet 2010 : 1 300 000 000 €

BTAN 3,00% 12 janvier 2010 : 700 000 000 €

► Repo et dépôt	au 30 septembre 2009	en moyenne sur le mois de septembre 2009	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	18 450 787 330,97	13 599 243 465,00	
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	23 340 000 000,00	-	23 340 000 000,00
Encours moyen	23 617 333 333,33	-	23 617 333 333,33

► **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 septembre 2009 : 6 ans et 229 jours

► **Références d'inflation applicables au 1er septembre 2009**

Aux OATi : 118,33

Aux OAT€ : 108,27