

Récapitulatif mensuel des opérations de l'AFT (en euros) Octobre 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	5,00%	25/10/2008	01/10/2009	1 748 000 000	06/10/2009	25/10/2016	112,09%	-
OAT	3,75%	25/10/2008	01/10/2009	4 678 000 000	06/10/2009	25/10/2019	101,48%	-
OAT	6,00%	25/10/2008	01/10/2009	1 881 000 000	06/10/2009	25/10/2025	123,43%	-
OAT	4,00%	25/04/2009	15/10/2009	825 000 000	20/10/2009	25/04/2013	106,09%	-
OAT	4,00%	25/04/2009	15/10/2009	1 080 000 000	20/10/2009	25/04/2014	106,16%	-
OATei	2,25%	25/07/2009	15/10/2009	696 000 000	20/10/2009	25/07/2020	107,17%	1,121320
OATi	2,10%	25/07/2009	15/10/2009	395 000 000	20/10/2009	25/07/2023	104,91%	1,030430
OATei	1,80%	25/07/2009	15/10/2009	665 000 000	20/10/2009	25/07/2040	101,84%	1,052420
TOTAL OAT				11 968 000 000				

► 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	15/10/2009	3 187 000 000	20/10/2009	12/09/2011	100,18%	-
BTAN	3,00%	12/07/2009	15/10/2009	2 890 000 000	20/10/2009	12/07/2014	101,69%	-
TOTAL BTAN				6 077 000 000				

► 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	05/10/2009	8	2 023	08/10/2009	03/12/2009	0,350
BTF	05/10/2009	13	4 145	08/10/2009	07/01/2010	0,393
BTF	05/10/2009	24	2 001	08/10/2009	25/03/2010	0,473
BTF	05/10/2009	50	2 003	08/10/2009	23/09/2010	0,667
BTF	12/10/2009	8	2 002	15/10/2009	10/12/2009	0,369
BTF	12/10/2009	12	4 370	15/10/2009	07/01/2010	0,403
BTF	12/10/2009	23	1 546	15/10/2009	25/03/2010	0,549
BTF	12/10/2009	49	2 501	15/10/2009	23/09/2010	0,772
BTF	19/10/2009	9	2 041	22/10/2009	24/12/2009	0,376
BTF	19/10/2009	13	4 641	22/10/2009	21/01/2010	0,416
BTF	19/10/2009	22	1 661	22/10/2009	25/03/2010	0,558
BTF	19/10/2009	52	2 151	22/10/2009	21/10/2010	0,865
BTF	26/10/2009	9	1 591	29/10/2009	31/12/2009	0,386
BTF	26/10/2009	12	4 873	29/10/2009	21/01/2010	0,401
BTF	26/10/2009	25	2 233	29/10/2009	22/04/2010	0,548
BTF	26/10/2009	51	2 262	29/10/2009	21/10/2010	0,832
TOTAL BTF			42 044			

► **Rachats de gré à gré :**

Montant nominal des rachats de gré à gré pour le compte de l'Etat : 3 129 000 000 €

BTAN 3,00% 12 janvier 2010 : 657 000 000 €

OAT 5,50% 25 avril 2010 : 180 000 000 €

BTAN 2,50% 12 juillet 2010 : 1 147 000 000 €

BTAN 3,75% 12 septembre 2010 : 1 145 000 000 €

► Repo et dépôt	au 31 octobre 2009	en moyenne sur le mois d'octobre 2009	
Encours des liquidités placées sous forme de pensions livrées	22 790 612 809,11	27 141 359 085,40	
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	23 520 000 000,00	-	23 520 000 000,00
Encours moyen	23 892 096 774,19	-	23 892 096 774,19

► Billets de trésorerie ACOSS souscrits	au 31 octobre 2009	en moyenne sur le mois d'octobre 2009
	0,00	293 548 387,10

► **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 octobre 2009 : 6 ans et 240 jours

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

Aux OATi : 117,80

Aux OAT€ : 107,51