

## COURBE DES TAUX DU 27 JANVIER 2017

| Code ISIN    | Taux du marché monétaire et Bons du Trésor | Taux actuariel<br>(existence d'une adjudication) | Taux interpolé | Valeur (pied de coupon) |
|--------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
|              | Taux moyen mensuel du marché monétaire     | 4,319%                                           |                |                         |
| TN0008003196 | BTC 52 semaines 07/02/2017                 |                                                  | 4,335%         |                         |
| TN0008003212 | BTC 52 semaines 23/05/2017                 |                                                  | 4,503%         |                         |
| TN0008003220 | BTC 52 semaines 27/06/2017                 |                                                  | 4,559%         |                         |
| TN0008000234 | BTA 10 ans "6,75% 11 juillet 2017"         |                                                  | 4,582%         | 1 009,114               |
| TN0008003246 | BTC 52 semaines 10/10/2017                 |                                                  | 4,727%         |                         |
| TN0008003253 | BTC 52 semaines 07/11/2017                 |                                                  | 4,772%         |                         |
| TN0008003261 | BTC 52 semaines 05/12/2017                 |                                                  | 4,817%         |                         |
| TN0008003279 | BTC 52 semaines 02/01/2018                 |                                                  | 4,861%         |                         |
| TN0008000341 | BTA 4 ans " 5.3% janvier 2018"             |                                                  | 4,882%         | 1 003,815               |
| TN0008003287 | BTC 52 semaines 30/01/2018                 | 4,906%                                           |                |                         |
| TN0008000317 | BTA 7 ans " 5,5% octobre 2018"             |                                                  | 5,219%         | 1 004,195               |
| TN0008000242 | BTZc 10 décembre 2018                      |                                                  | 5,291%         | 908,161                 |
| TN0008000275 | BTA 10 ans " 5,5% mars 2019"               |                                                  | 5,402%         | 1 001,754               |
| TN0008000333 | BTA 7 ans " 5,5% février 2020"             |                                                  | 5,816%         | 991,334                 |
| TN0008000358 | BTA 6 ans " 5,5% octobre 2020"             |                                                  | 6,117%         | 979,713                 |
| TN0008000564 | BTA 6 ans " 5,75% janvier 2021"            | 6,228%                                           |                | 983,585                 |
| TN0008000614 | BTA 6 ans "6% février 2022"                |                                                  | 6,622%         | 974,034                 |
| TN0008000226 | BTA 15 ans "6,9% 9 mai 2022"               |                                                  | 6,709%         | 1 007,829               |
| TN0008000291 | BTA 12 ans " 5,6% août 2022"               |                                                  | 6,802%         | 945,536                 |
| TN0008000572 | BTA 8 ans "6% avril 2023"                  |                                                  | 7,047%         | 948,406                 |
| TN0008000630 | BTA 7 ans "6% octobre 2023"                | 7,229%                                           |                | 935,991                 |
| TN0008000598 | BTA 8 ans " 6% janvier 2024"               | 7,354%                                           |                | 928,139                 |
| TN0008000366 | BTA 10 ans " 6% avril 2024"                |                                                  | 7,377%         | 924,779                 |
| TN0008000622 | BTA 10 ans "6,3% mars 2026"                | 7,554%                                           |                | 919,312                 |
| TN0008000580 | BTA 11 ans "6,3% octobre 2026"             |                                                  | 7,568%         | 914,460                 |
| TN0008000606 | BTA 12 ans "6,7% avril 2028"               | 7,602%                                           |                | 933,091                 |