

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,66%	1,66%	1,65	0,012
DE Benchmark 10Y	-0,10%	-0,11%	0,10	0,001
FR Benchmark 10Y	0,23%	0,22%	0,24	-0,0072
FR Benchmark 5Y	-0,23%	-0,24%	0,23	-0,007
UK Benchmark 10Y	1,08%	1,07%	1,08	0,000
TEC 10	0,18			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	81,89	82,96
Petrole Brut Baril	84,52	85,08
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,5508	2,5607
Gaz naturel	5,007	5,088
Or 1 Oc	1775,745	1769,15

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1642	1,164
EUR/JPY	133,308	133,302
EUR/GBP	0,84419	0,84414
EUR/CAD	1,4384	1,4379
EUR/CNY	7,443	7,4343
EUR/BRL	6,5054	6,4987

	EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
Pt de terme	VENTE		VENTE	
1 mois	6,76	6,89	5,09	5,45
3 mois	26,87	27,26	19,51	20,41
6 mois	48,42	49,32	46,15	47,54

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 2M	-0,69	-0,39
Deposit EUR 3M	-0,69	-0,39
Deposit EUR 6M	-0,67	-0,37
Deposit EUR 12M	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,487	15/10/2021
ECB ESTR Short Term	-0,573	19/10/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,573	18/10/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,561	18/10/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,548	18/10/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,527	18/10/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,48	18/10/2021

	30/09/2021	31/08/2021
TMO	0,26	0,09
TME	0,06	-0,11
TMM	-0,4849	-0,4832
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,557	-0,559
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,545	-0,548

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC21	100,535	100,54
I MAR22	100,5	100,505
I JUN22	100,455	100,46
I SEP22	100,385	100,39
I DEC22	100,32	100,325

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,59	-0,549
OIS EUR 3M	-0,59	-0,549
OIS EUR 6M	-0,586	-0,545
OIS EUR 1Y	-0,565	-0,524
OIS EUR 2Y	-0,474	-0,433
OIS EUR 3Y	-0,382	-0,341

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,553	-0,533
FRA EUR 2x5	-0,543	-0,523
FRA EUR 3x6	-0,534	-0,514
FRA EUR 6x9	-0,499	-0,479
FRA EUR 9x12	-0,443	-0,423
FRA EUR 3x9	-0,487	-0,467
FRA EUR 6x12	-0,438	-0,418
FRA EUR 9x15	-0,376	-0,356
FRA EUR 12x24	-0,206	-0,186

SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

SWAP EURIBOR 6 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
---------------------	---------	------------

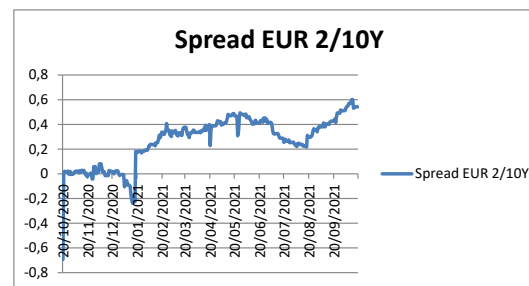
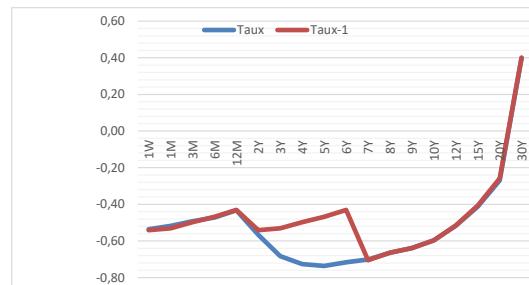
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
---------------------	---------	------------

IRS EUR 1Y	-0,3861	-0,3461
IRS EUR 2Y	-0,3924	-0,3524
IRS EUR 3Y	-0,3768	-0,3368
IRS EUR 4Y	-0,352	-0,312
IRS EUR 5Y	-0,3179	-0,2779
IRS EUR 6Y	-0,2773	-0,2373
IRS EUR 7Y	-0,2313	-0,1913
IRS EUR 10Y	-0,0748	-0,0348

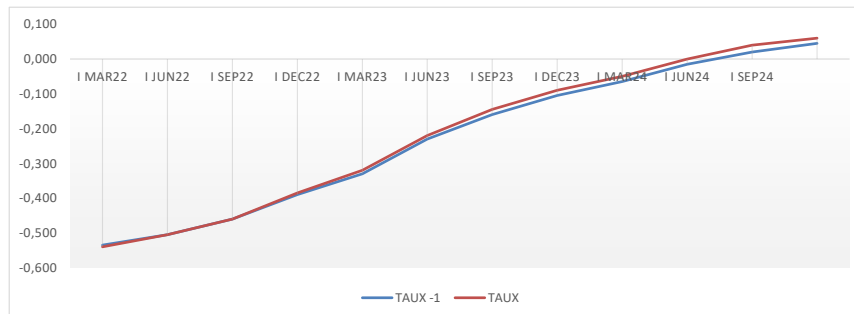
IRS EUR 1Y	-0,5241	-0,4841
IRS EUR 2Y	-0,3942	-0,3542
IRS EUR 3Y	-0,2834	-0,2434
IRS EUR 4Y	-0,1923	-0,1523
IRS EUR 5Y	-0,1093	-0,0693
IRS EUR 6Y	-0,0355	0,0045
IRS EUR 7Y	0,0343	0,0743
IRS EUR 10Y	0,2256	0,2656



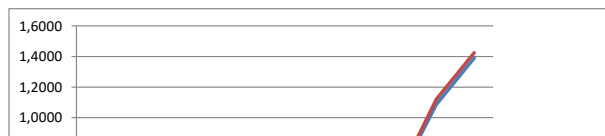
TAUX EURIBOR	18/10/2021	15/10/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,006
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,55	-0,55	0,000
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,53	0,001
EURIBOR 12M EUR	-0,48	-0,48	0,003
XEU Benchmark	15/10/2021	14/10/2021	Δ
XEU Benchmark 2Y	-0,71	-0,72	0,014
XEU Benchmark 3Y	-0,68	-0,70	0,015
XEU Benchmark 4Y	-0,65	-0,67	0,017
XEU Benchmark 5Y	-0,48	-0,51	0,028
XEU Benchmark 6Y	-0,47	-0,49	0,022
XEU Benchmark 7Y	-0,40	-0,42	0,024
XEU Benchmark 8Y	-0,03	-0,06	0,028
XEU Benchmark 9Y	0,07	0,07	0,000
XEU Benchmark 10Y	-0,17	-0,19	0,026
XEU Benchmark 12Y	0,33	0,30	0,027
XEU Benchmark 15Y	0,06	0,04	0,017
XEU Benchmark 20Y	0,07	0,05	0,020
TEC 30	0,88	0,88	0,000



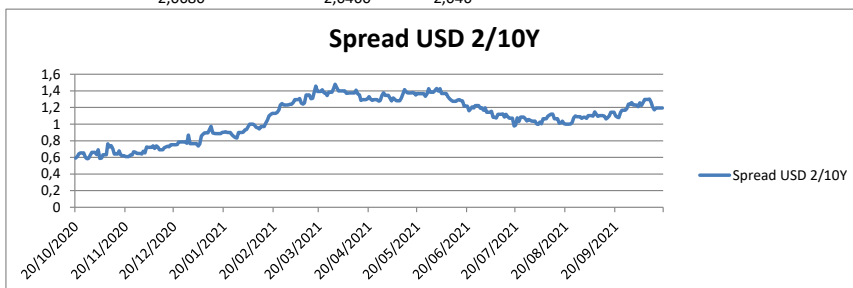
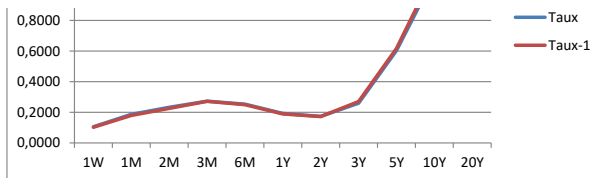
EURIBOR3M	20/10/2021	19/10/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,548						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC21	100,54	100,535	-0,540		101,080	-0,535	0,008
I MAR22	100,505	100,505	-0,505		101,010	-0,505	0,043
I JUN22	100,46	100,46	-0,460		100,920	-0,460	0,088
I SEP22	100,385	100,39	-0,385		100,770	-0,390	0,163
I DEC22	100,32	100,33	-0,320		100,640	-0,330	0,228
I MAR23	100,22	100,23	-0,220		100,440	-0,230	0,328
I JUN23	100,145	100,16	-0,145		100,290	-0,160	0,403
I SEP23	100,09	100,105	-0,090		100,180	-0,105	0,458
I DEC23	100,05	100,065	-0,050		100,100	-0,065	0,498
I MAR24	100	100,015	0,000		100,000	-0,015	0,548
I JUN24	99,96	99,98	0,040		99,920	0,020	0,588
I SEP24	99,94	99,955	0,060		99,880	0,045	0,608



TAUX US EMPRUNTEUR	18/10/2021	15/10/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0740	0,0749	0,075
LIBOR USD 1M	0,0856	0,0804	0,080
LIBOR 2M USD	0,1036	0,1014	0,101
LIBOR 3M USD	0,1315	0,1236	0,124



LIBOR 6M USD	0,1663	0,1605	0,161
	<b>19/10/2021</b>	<b>18/10/2021</b>	
USA Benchmark 1Y	0,2052	0,2098	0,210
US Benchmark 2Y	0,3494	0,3277	0,328
US Benchmark 3Y	0,6666	0,6769	0,677
US Benchmark 5Y	1,1441	1,1613	1,161
US Benchmark 10Y	1,5438	1,5002	1,500
US Benchmark 20Y	2,0063	1,9749	1,975
US Benchmark 30Y	2,0680	2,0460	2,046



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	18/10/2021	15/10/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0404	0,0403	0,04025
Libor 1 Week/GBP	0,0424	0,0410	0,041
LIBOR 1 Month/GBP	0,1190	0,0695	0,0695
LIBOR 2 Months/GBP	0,1885	0,0971	0,09713
LIBOR 3 Months/GBP	0,2135	0,1344	0,13438
LIBOR 6 Months/GBP	0,4151	0,2730	0,273
	<b>19/10/2021</b>	<b>18/10/2021</b>	
UK Benchmark 1Y	0,5406	0,4552	0,455214
UK Benchmark 2Y	0,6829	0,5908	0,590758
UK Benchmark 3Y	0,7388	0,6114	0,611364
UK Benchmark 4Y	0,7417	0,6350	0,635015
UK Benchmark 5Y	0,7694	0,8015	0,801476
UK Benchmark 6Y	0,8388	0,7773	0,777291
UK Benchmark 7Y	0,8251	0,7955	0,795481
UK Benchmark 8Y	0,9868	0,9487	0,948728
UK Benchmark 9Y	1,0243	0,9882	0,988162
UK Benchmark 10Y	1,0976	1,0535	1,053484
UK Benchmark 12Y	1,1413	1,1643	1,164336
UK Benchmark 15Y	1,2633	1,2935	1,293489
UK Benchmark 20Y	1,3816	1,3124	1,312396

