

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,70%	1,69%	1,68	0,016
DE Benchmark 10Y	-0,10%	-0,11%	0,09	-0,009
FR Benchmark 10Y	0,24%	0,23%	0,25	-0,0067
FR Benchmark 5Y	-0,23%	-0,24%	0,21	-0,020
UK Benchmark 10Y	1,12%	1,11%	1,12	0,000
TEC 10	0,2			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	82	82,5
Petrole Brut Baril	84,09	84,61
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,5312	2,5491
Gaz naturel	5,166	5,115
Or 1 Oc	1792,595	1782,8

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1634	1,1633
EUR/JPY	132,58	132,55
EUR/GBP	0,8436	0,8433
EUR/CAD	1,4365	1,43632
EUR/CNY	7,443	7,4344
EUR/BRL	6,5868	6,5806

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,78	6,9	4,73	5,29
3 mois	26,38	26,78	18,08	19,29
6 mois	48,57	49,47	43,43	45,93

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposit EUR 2M	-0,66	-0,36
Deposit EUR 3M	-0,7	-0,4
Deposit EUR 6M	-0,66	-0,36
Deposit EUR 12M	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,488	19/10/2021
ECB ESTR Short Term	-0,573	21/10/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,575	20/10/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,563	20/10/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,547	20/10/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,527	20/10/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,468	20/10/2021

	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	100,505	100,51
I JUN22	100,455	100,46
I SEP22	100,39	100,395
I DEC22	100,315	100,32

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	-0,473	-0,432
OIS EUR 3Y	-0,37	-0,329

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4		-0,523
FRA EUR 2x5	-0,543	-0,516
FRA EUR 3x6	-0,536	-0,478
FRA EUR 6x9	-0,498	-0,423
FRA EUR 9x12	-0,443	-0,468
FRA EUR 3x9	-0,488	-0,418
FRA EUR 6x12	-0,438	-0,356
FRA EUR 9x15	-0,376	-0,185
FRA EUR 12x24	-0,205	

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
---------------------	---------	------------

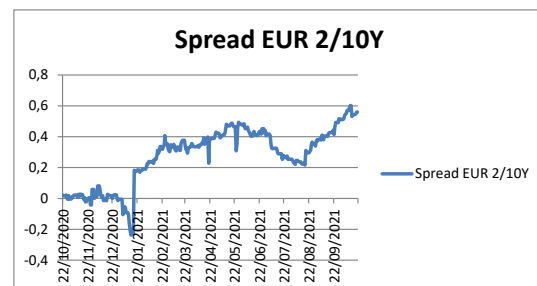
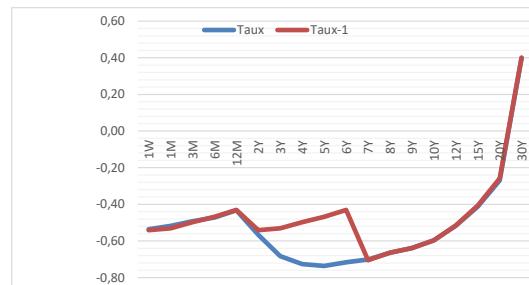
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
---------------------	---------	------------

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

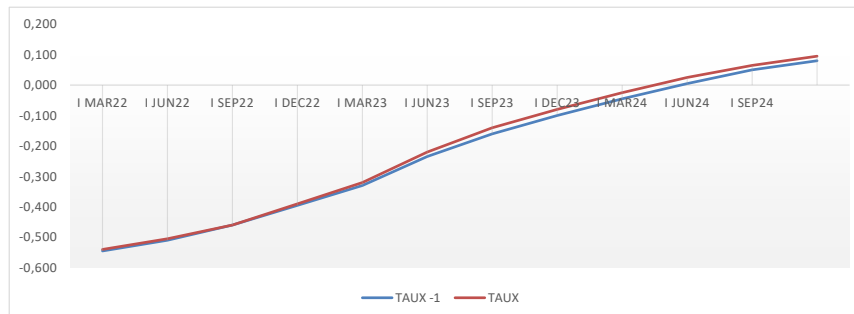
IRS EUR 1Y	-0,5248	-0,4848
IRS EUR 2Y	-0,3936	-0,3536
IRS EUR 3Y	-0,2779	-0,2379
IRS EUR 4Y	-0,1765	-0,1365
IRS EUR 5Y	-0,0862	-0,0462
IRS EUR 6Y	-0,0161	0,0239
IRS EUR 7Y	0,0498	0,0898
IRS EUR 10Y	0,2299	0,2699



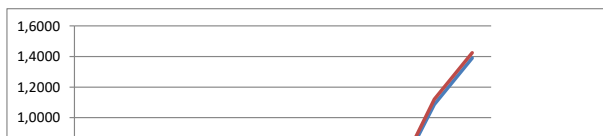
	20/10/2021	19/10/2021	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	-0,006
EURIBOR 3M EUR	-0,55	-0,55	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,52	-0,003
EURIBOR 12M EUR	-0,47	-0,47	-0,001
	20/10/2021	19/10/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,68	-0,65	-0,031
XEU Benchmark 3Y	-0,65	-0,62	-0,035
XEU Benchmark 4Y	-0,61	-0,58	-0,035
XEU Benchmark 5Y	-0,50	-0,46	-0,037
XEU Benchmark 6Y	-0,42	-0,39	-0,030
XEU Benchmark 7Y	-0,35	-0,32	-0,027
XEU Benchmark 8Y	0,01	0,05	-0,032
XEU Benchmark 9Y	0,12	0,15	-0,028
XEU Benchmark 10Y	-0,12	-0,10	-0,020
XEU Benchmark 12Y	0,37	0,39	-0,024
XEU Benchmark 15Y	0,08	0,10	-0,017
XEU Benchmark 20Y	0,08	0,09	-0,009
TEC 30	0,89	0,88	0,010



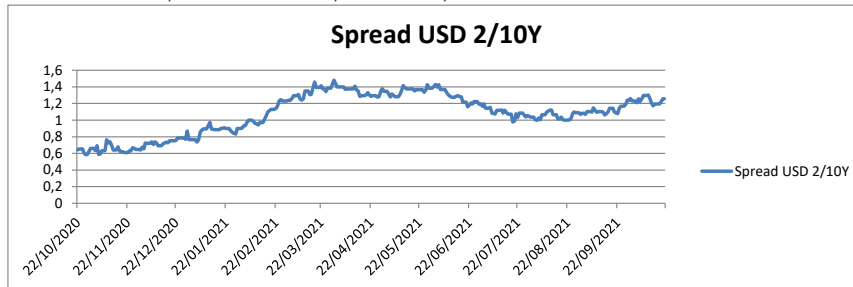
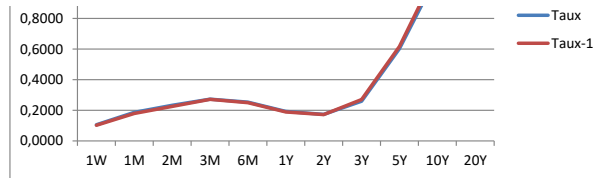
EURIBOR3M								
EURIBOR 3M EUR	-0,547							
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	22/10/2021	21/10/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX		
I DEC21	100,54	100,545	-0,540		101,080	-0,545	0,007	
I MAR22	100,505	100,51	-0,505		101,010	-0,510	0,042	
I JUN22	100,46	100,46	-0,460		100,920	-0,460	0,087	
I SEP22	100,39	100,395	-0,390		100,780	-0,395	0,157	
I DEC22	100,32	100,33	-0,320		100,640	-0,330	0,227	
I MAR23	100,22	100,235	-0,220		100,440	-0,235	0,327	
I JUN23	100,14	100,16	-0,140		100,280	-0,160	0,407	
I SEP23	100,08	100,1	-0,080		100,160	-0,100	0,467	
I DEC23	100,025	100,045	-0,025		100,050	-0,045	0,522	
I MAR24	99,975	99,995	0,025		99,950	0,005	0,572	
I JUN24	99,935	99,95	0,065		99,870	0,050	0,612	
I SEP24	99,905	99,92	0,095		99,810	0,080	0,642	



TAUX US EMPRUNTEUR				
Libor 1 Week/USD	20/10/2021	19/10/2021	Δ	
LIBOR USD 1M	0,0725	0,0751	0,075	
LIBOR USD 1M	0,0858	0,0856	0,086	
LIBOR 2M USD	0,1056	0,1078	0,108	
LIBOR 3M USD	0,1283	0,1295	0,130	



LIBOR 6M USD	0,1705	0,1675	0,168
	21/10/2021	20/10/2021	
USA Benchmark 1Y	0,1986	0,1986	0,199
US Benchmark 2Y	0,3633	0,3756	0,376
US Benchmark 3Y	0,6690	0,6497	0,650
US Benchmark 5Y	1,1615	1,1541	1,154
US Benchmark 10Y	1,6193	1,5956	1,596
US Benchmark 20Y	2,0764	2,0415	2,041
US Benchmark 30Y	2,1271	2,0789	2,079



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	20/10/2021	19/10/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0404	0,0409	0,04088
Libor 1 Week/GBP	0,0420	0,0436	0,04363
LIBOR 1 Month/GBP	0,1306	0,1241	0,12413
LIBOR 2 Months/GBP	0,1871	0,1833	0,18325
LIBOR 3 Months/GBP	0,2113	0,2159	0,21588
LIBOR 6 Months/GBP	0,4215	0,4193	0,41925
	21/10/2021	20/10/2021	
UK Benchmark 1Y	0,5427	0,5617	0,561676
UK Benchmark 2Y	0,6796	0,6589	0,65885
UK Benchmark 3Y	0,7211	0,7211	0,721064
UK Benchmark 4Y	0,7166	0,7222	0,722181
UK Benchmark 5Y	0,7657	0,7699	0,769891
UK Benchmark 6Y	0,8257	0,8381	0,838106
UK Benchmark 7Y	0,9097	0,9143	0,914295
UK Benchmark 8Y	0,9949	1,0054	1,005438
UK Benchmark 9Y	1,0952	1,0926	1,09255
UK Benchmark 10Y	1,1440	1,1427	1,142657
UK Benchmark 12Y	1,1863	1,2149	1,214915
UK Benchmark 15Y	1,3091	1,3066	1,306591
UK Benchmark 20Y	1,4330	1,3892	1,389191

