

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,63%	1,63%	1,64	-0,001
DE Benchmark 10Y	-0,11%	-0,12%	0,11	0,000
FR Benchmark 10Y	0,23%	0,22%	0,22	0,0021
FR Benchmark 5Y	-0,25%	-0,26%	0,25	0,004
UK Benchmark 10Y	1,05%	1,04%	1,05	0,000
TEC 10	0,23			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	83,54	83,76
Petrole Brut Baril	85,84	85,99
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,5594	2,5647
Gaz naturel	6,049	5,898
Or 1 Oc	1804,03	1807,8

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1606	1,1602
EUR/JPY	132,195	132,189
EUR/GBP	0,84204	0,84199
EUR/CAD	1,4374	1,4368
EUR/CNY	7,4108	7,4021
EUR/BRL	6,4502	6,4444

	EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
Pt de terme	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,04	7,11	5,03	5,29
3 mois	27,16	27,35	17,94	18,55
6 mois	49,55	50	42,85	43,92

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	-0,66	-0,36
Deposit EUR 12M	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,488	21/10/2021
ECB ESTR Short Term	-0,571	25/10/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,568	22/10/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,563	22/10/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,549	22/10/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,534	22/10/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,471	22/10/2021

	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	100,54	100,545
I MAR22	100,515	100,52
I JUN22	100,47	100,475
I SEP22	100,405	100,41
I DEC22	100,335	100,34

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,59	-0,549
OIS EUR 3M	-0,59	-0,549
OIS EUR 6M	-0,589	-0,548
OIS EUR 1Y	-0,574	-0,533
OIS EUR 2Y	-0,485	-0,444
OIS EUR 3Y	-0,382	-0,341

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,554	-0,534
FRA EUR 2x5	-0,545	-0,525
FRA EUR 3x6	-0,54	-0,52
FRA EUR 6x9	-0,508	-0,488
FRA EUR 9x12	-0,456	-0,436
FRA EUR 3x9	-0,496	-0,476
FRA EUR 6x12	-0,451	-0,431
FRA EUR 9x15	-0,392	-0,372
FRA EUR 12x24	-0,215	-0,195

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

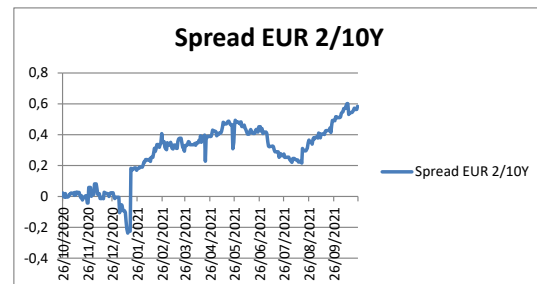
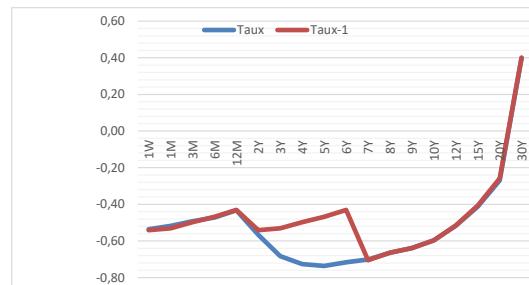
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
---------------------	---------	------------

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

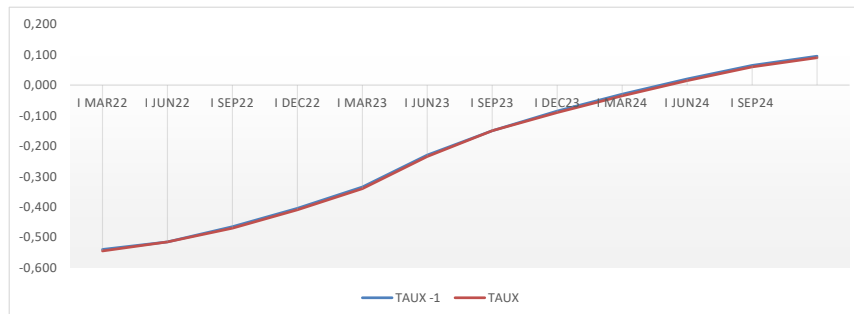
IRS EUR 1Y	-0,5312	-0,4912
IRS EUR 2Y	-0,4012	-0,3612
IRS EUR 3Y	-0,2761	-0,2361
IRS EUR 4Y	-0,1835	-0,1435
IRS EUR 5Y	-0,1046	-0,0646
IRS EUR 6Y	-0,0304	0,0096
IRS EUR 7Y	0,0399	0,0799
IRS EUR 10Y	0,2278	0,2678



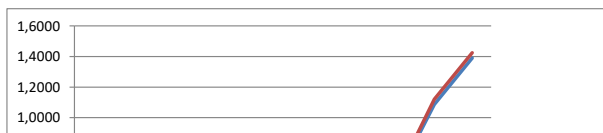
TAUX EURIBOR	22/10/2021	21/10/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,006
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	-0,004
EURIBOR 3M EUR	-0,55	-0,55	-0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,53	-0,002
EURIBOR 12M EUR	-0,47	-0,48	0,006
XEU Benchmark 2Y	25/10/2021	22/10/2021	
XEU Benchmark 3Y	-0,70	-0,67	-0,028
XEU Benchmark 4Y	-0,65	-0,63	-0,026
XEU Benchmark 5Y	-0,60	-0,57	-0,028
XEU Benchmark 6Y	-0,48	-0,44	-0,035
XEU Benchmark 7Y	-0,41	-0,38	-0,024
XEU Benchmark 8Y	-0,34	-0,32	-0,019
XEU Benchmark 9Y	0,02	0,05	-0,021
XEU Benchmark 10Y	0,13	0,14	-0,018
XEU Benchmark 12Y	-0,12	-0,11	-0,008
XEU Benchmark 15Y	0,37	0,38	-0,012
XEU Benchmark 20Y	0,08	0,08	-0,001
XEU Benchmark 30Y	0,07	0,05	0,015
TEC 30	0,89	0,90	-0,010



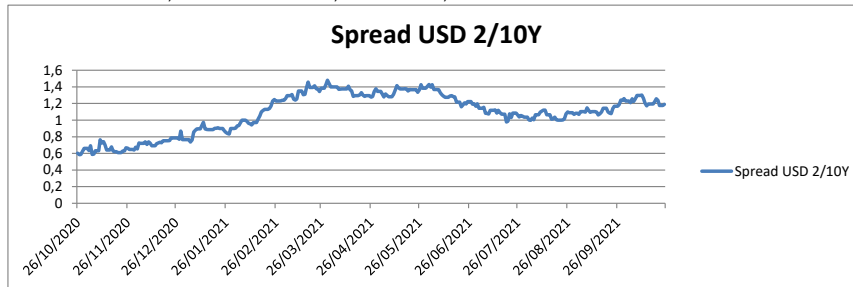
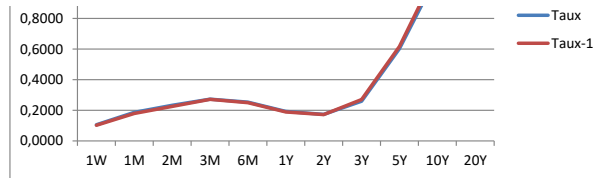
EURIBOR3M							
EURIBOR 3M EUR	-0,549						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	26/10/2021	25/10/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
I DEC21	100,545	100,54	-0,545		101,090	-0,540	0,004
I MAR22	100,515	100,515	-0,515		101,030	-0,515	0,034
I JUN22	100,47	100,465	-0,470		100,940	-0,465	0,079
I SEP22	100,41	100,405	-0,410		100,820	-0,405	0,139
I DEC22	100,34	100,335	-0,340		100,680	-0,335	0,209
I MAR23	100,235	100,23	-0,235		100,470	-0,230	0,314
I JUN23	100,15	100,15	-0,150		100,300	-0,150	0,399
I SEP23	100,09	100,085	-0,090		100,180	-0,085	0,459
I DEC23	100,035	100,03	-0,035		100,070	-0,030	0,514
I MAR24	99,985	99,98	0,015		99,970	0,020	0,564
I JUN24	99,94	99,935	0,060		99,880	0,065	0,609
I SEP24	99,91	99,905	0,090		99,820	0,095	0,639



TAUX US EMPRUNTEUR			
	22/10/2021	21/10/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0753	0,0724	0,072
LIBOR USD 1M	0,0879	0,0893	0,089
LIBOR 2M USD	0,1021	0,0988	0,099
LIBOR 3M USD	0,1249	0,1239	0,124



LIBOR 6M USD	0,1720	0,1703	0,170
	25/10/2021	22/10/2021	
USA Benchmark 1Y	0,2215	0,2014	0,201
US Benchmark 2Y	0,4147	0,4745	0,475
US Benchmark 3Y	0,6978	0,7399	0,740
US Benchmark 5Y	1,1717	1,2105	1,211
US Benchmark 10Y	1,6034	1,6511	1,651
US Benchmark 20Y	2,0493	2,0714	2,071
US Benchmark 30Y	2,0968	2,1025	2,102



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	22/10/2021	21/10/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0408	0,0406	0,04063
Libor 1 Week/GBP	0,0438	0,0428	0,04275
LIBOR 1 Month/GBP	0,1156	0,1283	0,12825
LIBOR 2 Months/GBP	0,1591	0,1791	0,17913
LIBOR 3 Months/GBP	0,1960	0,2144	0,21438
LIBOR 6 Months/GBP	0,4073	0,4238	0,42375
	25/10/2021	22/10/2021	
UK Benchmark 1Y	0,9453	0,7951	0,79512
UK Benchmark 2Y	0,6140	0,6414	0,641413
UK Benchmark 3Y	0,6879	0,7104	0,710422
UK Benchmark 4Y	0,6887	0,7141	0,714052
UK Benchmark 5Y	0,7538	0,7787	0,778651
UK Benchmark 6Y	0,8260	0,8581	0,858143
UK Benchmark 7Y	0,8998	0,9078	0,907759
UK Benchmark 8Y	0,9884	1,0227	1,022699
UK Benchmark 9Y	1,0793	1,0871	1,087146
UK Benchmark 10Y	1,1566	1,2015	1,201456
UK Benchmark 12Y	1,1679	1,1781	1,178063
UK Benchmark 15Y	1,2774	1,2841	1,284134
UK Benchmark 20Y	1,4044	1,4108	1,410808

