

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,54%	1,54%	1,53	0,010
DE Benchmark 10Y	-0,22%	-0,23%	0,22	-0,001
FR Benchmark 10Y	0,12%	0,11%	0,12	-0,0009
FR Benchmark 5Y	-0,36%	-0,37%	0,36	-0,003
UK Benchmark 10Y	0,86%	0,85%	0,86	0,000
TEC 10	0,16			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	79,15	78,81
Petrole Brut Baril	80,57	80,54
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,4081	2,4066
Gaz naturel	5,575	5,716
Or 1 Oc	1797,122	1791,125

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1564	1,1561
EUR/JPY	131,491	131,485
EUR/GBP	0,85592	0,85587
EUR/CAD	1,44069	1,44055
EUR/CNY	7,4038	7,3953
EUR/BRL	6,4822	6,4762

Pnt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,36	6,46	4,08	4,38
3 mois	26,59	26,85	16,15	16,9
6 mois	48,54	49,24	37,76	40,19

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,73	-0,43
Deposits EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposits EUR 2M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,67	-0,37
Deposits EUR 12M	-0,64	-0,34

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,484	02/11/2021
ECB ESTR Short Term	-0,573	04/11/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,573	03/11/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,565	03/11/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,573	03/11/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,538	03/11/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,482	03/11/2021

	31/10/2021	30/09/2021
TMO	0,43	0,26
TME	0,23	0,06
TMM	-0,4859	-0,4849
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,56	-0,557
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,55	-0,545

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC21	100,56	100,565
I MAR22	100,515	100,52
I JUN22	100,465	100,47
I SEP22	100,41	100,415
I DEC22	100,34	100,345

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,591	-0,55
OIS EUR 3M	-0,591	-0,55
OIS EUR 6M	-0,586	-0,545
OIS EUR 1Y	-0,564	-0,523
OIS EUR 2Y	-0,488	-0,447
OIS EUR 3Y	-0,416	-0,375

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,576	-0,556
FRA EUR 2x5	-0,563	-0,543
FRA EUR 3x6	-0,551	-0,531
FRA EUR 6x9	-0,506	-0,486
FRA EUR 9x12	-0,453	-0,433
FRA EUR 3x9	-0,499	-0,479
FRA EUR 6x12	-0,448	-0,428
FRA EUR 9x15	-0,388	-0,368
FRA EUR 12x24	-0,233	-0,213

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
IRS EUR 1Y	-0,3861	-0,3461

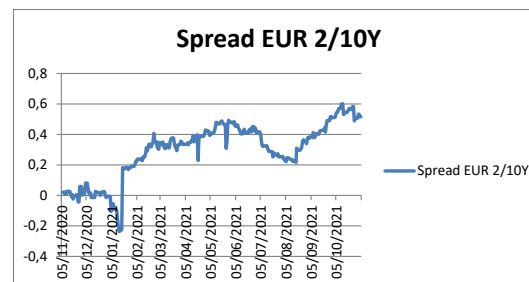
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5378	-0,4978

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

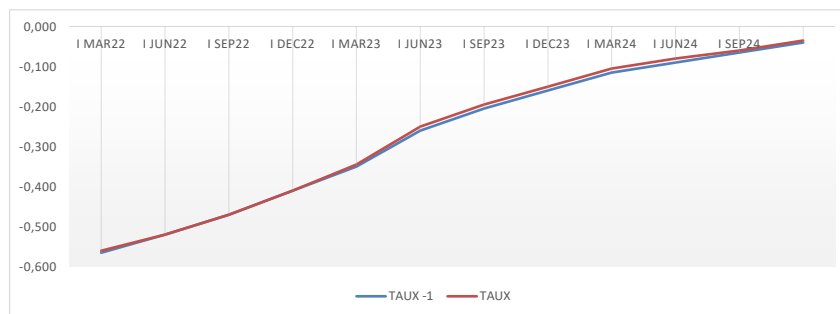
IRS EUR 2Y	-0,415	-0,375
IRS EUR 3Y	-0,3224	-0,2824
IRS EUR 4Y	-0,2449	-0,2049
IRS EUR 5Y	-0,1948	-0,1548
IRS EUR 6Y	-0,1354	-0,0954
IRS EUR 7Y	-0,0751	-0,0351
IRS EUR 10Y	0,1058	0,1458



TAUX EURIBOR	03/11/2021	02/11/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,000
EURIBOR 1M EUR	-0,57	-0,56	-0,005
EURIBOR 3M EUR	-0,57	-0,57	-0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,53	-0,004
EURIBOR 12M EUR	-0,48	-0,46	-0,021
XEU Benchmark 2Y	03/11/2021	02/11/2021	Δ
XEU Benchmark 2Y	-0,68	-0,70	0,014
XEU Benchmark 3Y	-0,65	-0,66	0,012
XEU Benchmark 4Y	-0,62	-0,62	0,004
XEU Benchmark 5Y	-0,51	-0,50	-0,010
XEU Benchmark 6Y	-0,44	-0,44	0,006
XEU Benchmark 7Y	-0,37	-0,38	0,004
XEU Benchmark 8Y	-0,01	0,00	-0,011
XEU Benchmark 9Y	0,08	0,08	0,000
XEU Benchmark 10Y	-0,17	-0,17	0,000
XEU Benchmark 12Y	0,32	0,34	-0,019
XEU Benchmark 15Y	-0,01	-0,01	-0,003
XEU Benchmark 20Y	-0,04	-0,03	-0,017
TEC 30	0,80	0,76	0,040



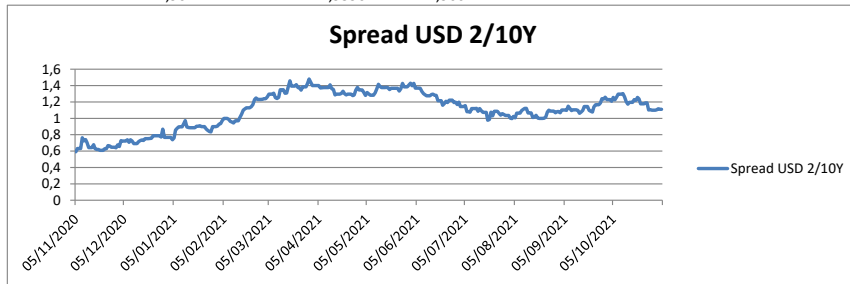
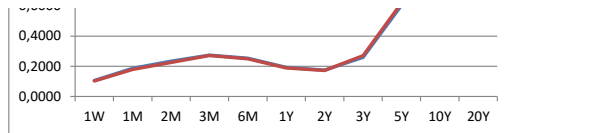
EURIBOR3M	05/11/2021	04/11/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,573						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC21	100,56	100,565	-0,560		101,120	-0,565	0,013
I MAR22	100,52	100,52	-0,520		101,040	-0,520	0,053
I JUN22	100,47	100,47	-0,470		100,940	-0,470	0,103
I SEP22	100,41	100,41	-0,410		100,820	-0,410	0,163
I DEC22	100,345	100,35	-0,345		100,690	-0,350	0,228
I MAR23	100,25	100,26	-0,250		100,500	-0,260	0,323
I JUN23	100,195	100,205	-0,195		100,390	-0,205	0,378
I SEP23	100,15	100,16	-0,150		100,300	-0,160	0,423
I DEC23	100,105	100,115	-0,105		100,210	-0,115	0,468
I MAR24	100,08	100,09	-0,080		100,160	-0,090	0,493
I JUN24	100,06	100,065	-0,060		100,120	-0,065	0,513
I SEP24	100,035	100,04	-0,035		100,070	-0,040	0,538



TAUX US EMPRUNTEUR	03/11/2021	02/11/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0741	0,0734	0,073
LIBOR USD 1M	0,0855	0,0809	0,081
LIBOR 2M USD	0,1148	0,1135	0,114
LIBOR 3M USD	0,1398	0,1450	0,145
LIBOR 6M USD	0,2185	0,2208	0,221
	04/11/2021	03/11/2021	



USA Benchmark 1Y	0,2443	0,2314	0,231
US Benchmark 2Y	0,4322	0,4052	0,405
US Benchmark 3Y	0,7172	0,7332	0,733
US Benchmark 5Y	1,1703	1,1843	1,184
US Benchmark 10Y	1,5423	1,5232	1,523
US Benchmark 20Y	1,9562	1,9659	1,966
US Benchmark 30Y	1,9642	1,9596	1,960



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	03/11/2021	02/11/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0405	0,0411	0,04113
Libor 1 Week/GBP	0,1161	0,1025	0,1025
LIBOR 1 Month/GBP	0,1594	0,1490	0,149
LIBOR 2 Months/GBP	0,2021	0,1951	0,19513
LIBOR 3 Months/GBP	0,2289	0,2268	0,22675
LIBOR 6 Months/GBP	0,4438	0,4384	0,43838
	<b>04/11/2021</b>	<b>03/11/2021</b>	
UK Benchmark 1Y	0,3925	0,9498	0,9498
UK Benchmark 2Y	0,6161	0,6226	0,622601
UK Benchmark 3Y	0,7318	0,7404	0,740435
UK Benchmark 4Y	0,7257	0,7257	0,725661
UK Benchmark 5Y	0,7660	0,7895	0,789483
UK Benchmark 6Y	0,8315	0,8297	0,829733
UK Benchmark 7Y	0,8677	0,8320	0,832019
UK Benchmark 8Y	0,9542	0,9515	0,951541
UK Benchmark 9Y	1,0123	0,9724	0,972445
UK Benchmark 10Y	1,0252	1,0611	1,061082
UK Benchmark 12Y	1,0871	1,1000	1,099977
UK Benchmark 15Y	1,1758	1,1915	1,191496
UK Benchmark 20Y	1,2850	1,2402	1,240153

