

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

| LONGS ETATS      | ACHAT  | VENTE  | ACHAT CLOSE | Δ       |
|------------------|--------|--------|-------------|---------|
| US Benchmark 10Y | 1,55%  | 1,55%  | 1,55        | 0,000   |
| DE Benchmark 10Y | -0,25% | -0,25% | 0,23        | -0,018  |
| FR Benchmark 10Y | 0,11%  | 0,11%  | 0,13        | -0,0148 |
| FR Benchmark 5Y  | -0,33% | -0,34% | 0,31        | -0,021  |
| UK Benchmark 10Y | 0,85%  | 0,84%  | 0,85        | -0,005  |
| TEC 10           | 0,05   |        |             |         |

| ENERGIE ET OR (USD) | Cours   | Close   |
|---------------------|---------|---------|
| Petrole Brut WTI    | 81,28   | 81,34   |
| Petrole Brut Baril  | 82,67   | 82,64   |
| Electricity NYHubZJ | 26,6    | 26,6    |
| Heating oil/fuel    | 2,4428  | 2,4521  |
| Gaz naturel         | 4,942   | 4,88    |
| Or 1 Oc             | 1861,21 | 1848,89 |

## DEVISES

| Parités | VENTE   | ACHAT   |
|---------|---------|---------|
| EUR/USD | 1,1471  | 1,1468  |
| EUR/JPY | 130,825 | 130,819 |
| EUR/GBP | 0,85699 | 0,85693 |
| EUR/CAD | 1,43686 | 1,43671 |
| EUR/CNY | 7,3478  | 7,3392  |
| EUR/BRL | 6,3002  | 6,2943  |

|             | EUR/USD | ACHAT | EUR/GBP | ACHAT |
|-------------|---------|-------|---------|-------|
| Pt de terme | VENTE   |       | VENTE   |       |
| 1 mois      | 6,34    | 6,42  | 4,29    | 4,41  |
| 3 mois      | 27,53   | 27,73 | 17,04   | 17,33 |
| 6 mois      | 50,24   | 50,94 | 40,25   | 41,26 |

## MARCHE MONETAIRE

| MARCHE MONETAIRE EUR | VENTE | ACHAT |
|----------------------|-------|-------|
| Deposit EUR ON       | -0,73 | -0,43 |
| Deposit EUR 1M       | -0,69 | -0,39 |
| Deposit EUR 2M       | -0,75 | -0,45 |
| Deposit EUR 3M       | -0,74 | -0,44 |
| Deposit EUR 6M       | -0,67 | -0,37 |
| Deposit EUR 12M      | -0,64 | -0,34 |

| FIXING              | TAUX   | DATE       |
|---------------------|--------|------------|
| EONIA               | -0,49  | 09/11/2021 |
| ECB ESTR Short Term | -0,575 | 09/11/2021 |
| EURIBOR 1W EUR      | -0,581 | 09/11/2021 |
| EURIBOR 1M EUR      | -0,563 | 09/11/2021 |
| EURIBOR 3M EUR      | -0,565 | 09/11/2021 |
| EURIBOR 6M EUR      | -0,533 | 09/11/2021 |
| EURIBOR 12M EUR     | -0,498 | 09/11/2021 |

|                     | 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 TA | PRETEUR     | EMPRUNTEUR |
|-------------------------|-------------|------------|
| LIFFE                   | EURIBOR 3 M |            |
| I DEC21                 | 100,56      | 100,565    |
| I MAR22                 | 100,505     | 100,51     |
| I JUN22                 | 100,425     | 100,43     |
| I SEP22                 | 100,34      | 100,345    |
| I DEC22                 | 100,24      | 100,245    |

| SWAP ESTER | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|------------|---------|------------|
| OIS EUR 1M | -0,592  | -0,551     |
| OIS EUR 3M | -0,593  | -0,552     |
| OIS EUR 6M | -0,586  | -0,545     |
| OIS EUR 1Y | -0,543  | -0,502     |
| OIS EUR 2Y | -0,41   | -0,369     |
| OIS EUR 3Y | -0,312  | -0,271     |

| FRA's         | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------|---------|------------|
| FRA EUR 1x4   | -0,572  | -0,552     |
| FRA EUR 2x5   | -0,555  | -0,535     |
| FRA EUR 3x6   | -0,54   | -0,52      |
| FRA EUR 6x9   | -0,467  | -0,447     |
| FRA EUR 9x12  | -0,385  | -0,365     |
| FRA EUR 3x9   | -0,479  | -0,459     |
| FRA EUR 6x12  | -0,398  | -0,378     |
| FRA EUR 9x15  | -0,312  | -0,292     |
| FRA EUR 12x24 | -0,089  | -0,069     |

| 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 |
|---------------------|---------|------------|
|---------------------|---------|------------|

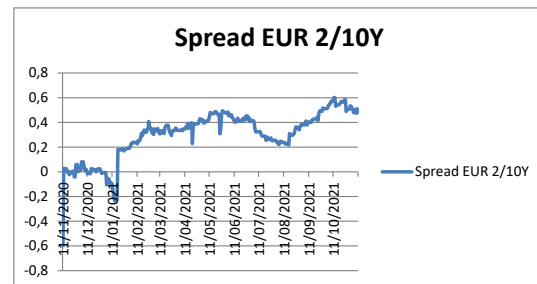
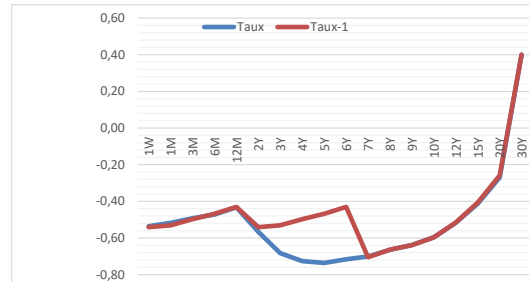
| SWAP EURIBOR 3 MOIS | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------------|---------|------------|
|---------------------|---------|------------|

|             |         |         |
|-------------|---------|---------|
| 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 |

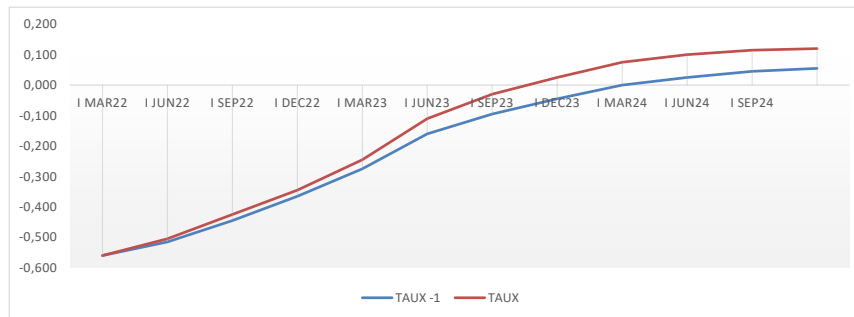
|             |         |         |
|-------------|---------|---------|
| IRS EUR 1Y  | -0,5081 | -0,4681 |
| IRS EUR 2Y  | -0,3274 | -0,2874 |
| IRS EUR 3Y  | -0,2049 | -0,1649 |
| IRS EUR 4Y  | -0,1475 | -0,1075 |
| IRS EUR 5Y  | -0,1023 | -0,0623 |
| IRS EUR 6Y  | -0,0589 | -0,0189 |
| IRS EUR 7Y  | -0,0112 | 0,0288  |
| IRS EUR 10Y | 0,1427  | 0,1827  |



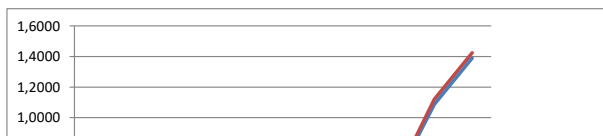
| TAUX EURIBOR      | 09/11/2021 | 08/11/2021 | Δ      |
|-------------------|------------|------------|--------|
| EURIBOR 1W EUR    | -0,58      | -0,57      | -0,009 |
| EURIBOR 1M EUR    | -0,56      | -0,57      | 0,010  |
| EURIBOR 3M EUR    | -0,57      | -0,57      | 0,007  |
| EURIBOR 6M EUR    | -0,53      | -0,54      | 0,004  |
| EURIBOR 12M EUR   | -0,50      | -0,50      | 0,003  |
| XEU Benchmark 2Y  | 10/11/2021 | 09/11/2021 | Δ      |
| XEU Benchmark 2Y  | -0,76      | -0,77      | 0,019  |
| XEU Benchmark 3Y  | -0,72      | -0,75      | 0,026  |
| XEU Benchmark 4Y  | -0,69      | -0,74      | 0,046  |
| XEU Benchmark 5Y  | -0,57      | -0,62      | 0,048  |
| XEU Benchmark 6Y  | -0,51      | -0,57      | 0,057  |
| XEU Benchmark 7Y  | -0,46      | -0,51      | 0,056  |
| XEU Benchmark 8Y  | -0,08      | -0,15      | 0,064  |
| XEU Benchmark 9Y  | 0,01       | -0,06      | 0,065  |
| XEU Benchmark 10Y | -0,25      | -0,30      | 0,056  |
| XEU Benchmark 12Y | 0,26       | 0,20       | 0,062  |
| XEU Benchmark 15Y | -0,09      | -0,14      | 0,053  |
| XEU Benchmark 20Y | -0,13      | -0,18      | 0,050  |
| TEC 30            | 0,72       | 0,74       | -0,020 |



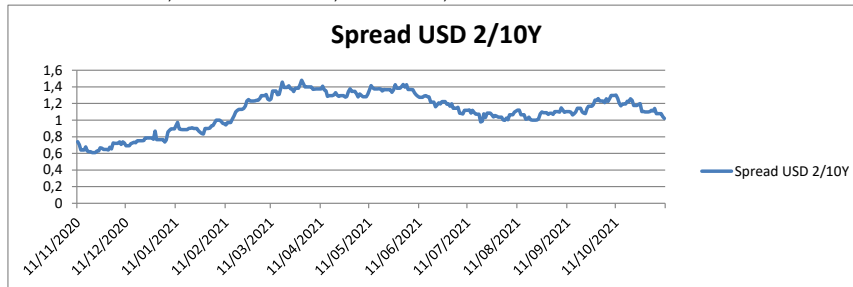
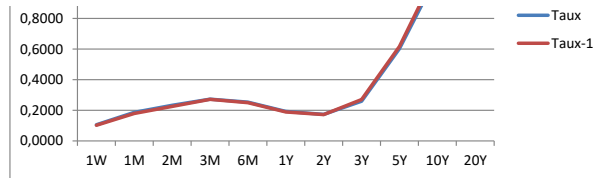
| EURIBOR3M             | 11/11/2021 | 10/11/2021 | TAUX   | Δ | TAUX VEILLE | Δ/FIX  |       |
|-----------------------|------------|------------|--------|---|-------------|--------|-------|
| EURIBOR 3M EUR        | -0,565     |            |        |   |             |        |       |
| LIFFE EURIBOR3M/ROLLS |            |            |        |   |             |        |       |
| I DEC21               | 100,56     | 100,56     | -0,560 |   | 101,120     | -0,560 | 0,005 |
| I MAR22               | 100,505    | 100,515    | -0,505 |   | 101,010     | -0,515 | 0,060 |
| I JUN22               | 100,425    | 100,445    | -0,425 |   | 100,850     | -0,445 | 0,140 |
| I SEP22               | 100,345    | 100,365    | -0,345 |   | 100,690     | -0,365 | 0,220 |
| I DEC22               | 100,245    | 100,275    | -0,245 |   | 100,490     | -0,275 | 0,320 |
| I MAR23               | 100,11     | 100,16     | -0,110 |   | 100,220     | -0,160 | 0,455 |
| I JUN23               | 100,03     | 100,095    | -0,030 |   | 100,060     | -0,095 | 0,535 |
| I SEP23               | 99,975     | 100,045    | 0,025  |   | 99,950      | -0,045 | 0,590 |
| I DEC23               | 99,925     | 100        | 0,075  |   | 99,850      | 0,000  | 0,640 |
| I MAR24               | 99,9       | 99,975     | 0,100  |   | 99,800      | 0,025  | 0,665 |
| I JUN24               | 99,885     | 99,955     | 0,115  |   | 99,770      | 0,045  | 0,680 |
| I SEP24               | 99,88      | 99,945     | 0,120  |   | 99,760      | 0,055  | 0,685 |



| TAUX US EMPRUNTEUR | 09/11/2021 | 08/11/2021 | Δ     |
|--------------------|------------|------------|-------|
| Libor 1 Week/USD   | 0,0720     | 0,0723     | 0,072 |
| LIBOR USD 1M       | 0,0893     | 0,0911     | 0,091 |
| LIBOR 2M USD       | 0,1129     | 0,1136     | 0,114 |
| LIBOR 3M USD       | 0,1495     | 0,1456     | 0,146 |



|                  |                   |                   |       |
|------------------|-------------------|-------------------|-------|
| LIBOR 6M USD     | 0,2151            | 0,2190            | 0,219 |
|                  | <b>10/11/2021</b> | <b>09/11/2021</b> |       |
| USA Benchmark 1Y | 0,2230            | 0,2248            | 0,225 |
| US Benchmark 2Y  | 0,4590            | 0,3734            | 0,373 |
| US Benchmark 3Y  | 0,7691            | 0,6662            | 0,666 |
| US Benchmark 5Y  | 1,1886            | 1,0769            | 1,077 |
| US Benchmark 10Y | 1,4791            | 1,4154            | 1,415 |
| US Benchmark 20Y | 1,9050            | 1,8386            | 1,839 |
| US Benchmark 30Y | 1,8799            | 1,8342            | 1,834 |



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

|                    | 09/11/2021        | 08/11/2021        | Δ        |
|--------------------|-------------------|-------------------|----------|
| LIBOR ON/GBP       | 0,0403            | 0,0386            | 0,03863  |
| Libor 1 Week/GBP   | 0,0405            | 0,0431            | 0,04313  |
| LIBOR 1 Month/GBP  | 0,0528            | 0,0514            | 0,05138  |
| LIBOR 2 Months/GBP | 0,0853            | 0,0874            | 0,08738  |
| LIBOR 3 Months/GBP | 0,1148            | 0,1089            | 0,10888  |
| LIBOR 6 Months/GBP | 0,2926            | 0,2793            | 0,27925  |
|                    | <b>10/11/2021</b> | <b>09/11/2021</b> |          |
| UK Benchmark 1Y    | 1,0352            | 0,3606            | 0,360621 |
| UK Benchmark 2Y    | 0,5372            | 0,4385            | 0,438471 |
| UK Benchmark 3Y    | 0,6033            | 0,5055            | 0,505509 |
| UK Benchmark 4Y    | 0,5667            | 0,4762            | 0,476191 |
| UK Benchmark 5Y    | 0,6265            | 0,5221            | 0,522056 |
| UK Benchmark 6Y    | 0,6985            | 0,5811            | 0,581093 |
| UK Benchmark 7Y    | 0,7198            | 0,6239            | 0,623906 |
| UK Benchmark 8Y    | 0,8047            | 0,6984            | 0,698395 |
| UK Benchmark 9Y    | 0,8412            | 0,7688            | 0,76881  |
| UK Benchmark 10Y   | 0,8702            | 0,8357            | 0,835696 |
| UK Benchmark 12Y   | 0,9379            | 0,8614            | 0,861402 |
| UK Benchmark 15Y   | 1,0287            | 0,9489            | 0,948895 |
| UK Benchmark 20Y   | 1,0768            | 1,0462            | 1,046229 |

