

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,57%	1,56%	1,56	0,007
DE Benchmark 10Y	-0,26%	-0,27%	0,26	0,000
FR Benchmark 10Y	0,11%	0,10%	0,11	0
FR Benchmark 5Y	-0,35%	-0,36%	0,35	0,000
UK Benchmark 10Y	0,83%	0,83%	0,83	0,000
TEC 10	0,12			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	80,06	80,79
Petrole Brut Baril	81,3	82,17
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,3779	2,4037
Gaz naturel	4,882	4,791
Or 1 Oc	1857,322	1864,855

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,146	1,1458
EUR/JPY	130,594	130,588
EUR/GBP	0,8531	0,8528
EUR/CAD	1,43639	1,43622
EUR/CNY	7,317	7,3083
EUR/BRL	6,2598	6,2521

Pnt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,27	6,39	4,14	4,51
3 mois	27,32	27,62	16,59	17,51
6 mois	49,68	50,73	38,06	42,03

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,73	-0,43
Deposits EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposits EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,67	-0,37
Deposits EUR 12M	-0,63	-0,33

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,49	11/11/2021
ECB ESTR Short Term	-0,575	11/11/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,569	12/11/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,566	12/11/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,562	12/11/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,533	12/11/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,473	12/11/2021

	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	100,52	100,525
I JUN22	100,45	100,455
I SEP22	100,375	100,385
I DEC22	100,29	100,295

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,594	-0,553
OIS EUR 3M	-0,594	-0,553
OIS EUR 6M	-0,59	-0,549
OIS EUR 1Y	-0,562	-0,521
OIS EUR 2Y	-0,454	-0,413
OIS EUR 3Y	-0,366	-0,325

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4		
FRA EUR 2x5		
FRA EUR 3x6		
FRA EUR 6x9		
FRA EUR 9x12	-0,419	-0,399
FRA EUR 3x9		
FRA EUR 6x12	-0,427	-0,407
FRA EUR 9x15	-0,351	-0,331
FRA EUR 12x24	-0,153	-0,133

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

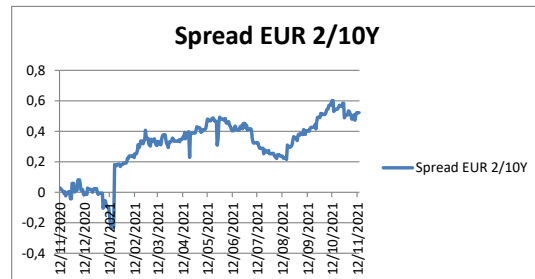
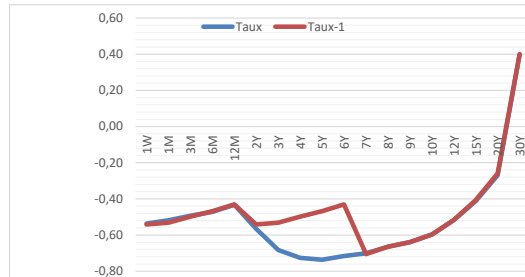
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5225	-0,4825

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

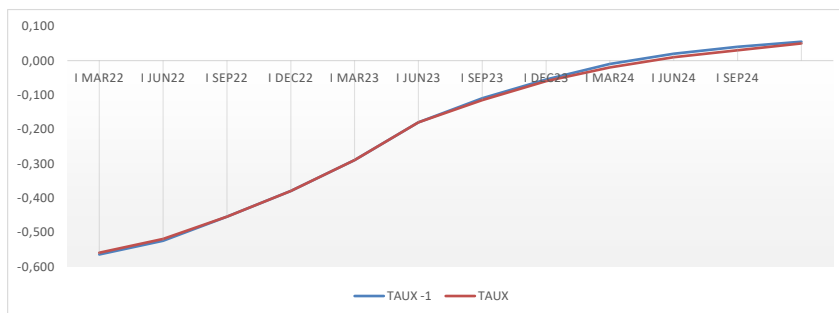
IRS EUR 2Y	-0,3667	-0,3267
IRS EUR 3Y	-0,243	-0,203
IRS EUR 4Y	-0,1766	-0,1366
IRS EUR 5Y	-0,1334	-0,0934
IRS EUR 6Y	-0,0869	-0,0469
IRS EUR 7Y	-0,0368	0,0032
IRS EUR 10Y	0,1286	0,1686



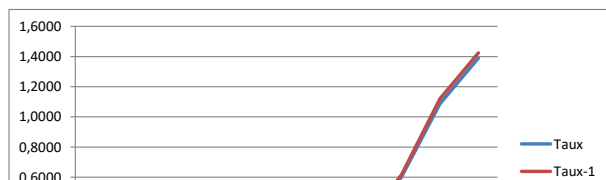
TAUX EURIBOR	12/11/2021	11/11/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,58	0,009
EURIBOR 1M EUR	-0,57	-0,57	0,008
EURIBOR 3M EUR	-0,56	-0,56	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,53	-0,006
EURIBOR 12M EUR	-0,47	-0,48	0,005
XEU Benchmark 2Y	11/11/2021	10/11/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,76	-0,76	-0,001
XEU Benchmark 3Y	-0,71	-0,72	0,005
XEU Benchmark 4Y	-0,69	-0,69	0,007
XEU Benchmark 5Y	-0,55	-0,55	0,000
XEU Benchmark 6Y	-0,50	-0,51	0,009
XEU Benchmark 7Y	-0,45	-0,46	0,008
XEU Benchmark 8Y	-0,07	-0,08	0,017
XEU Benchmark 9Y	0,02	0,02	-0,001
XEU Benchmark 10Y	-0,23	-0,25	0,012
XEU Benchmark 12Y	0,27	0,26	0,008
XEU Benchmark 15Y	-0,07	-0,09	0,013
XEU Benchmark 20Y	-0,12	-0,13	0,010
TEC 30	0,76	0,76	0,000



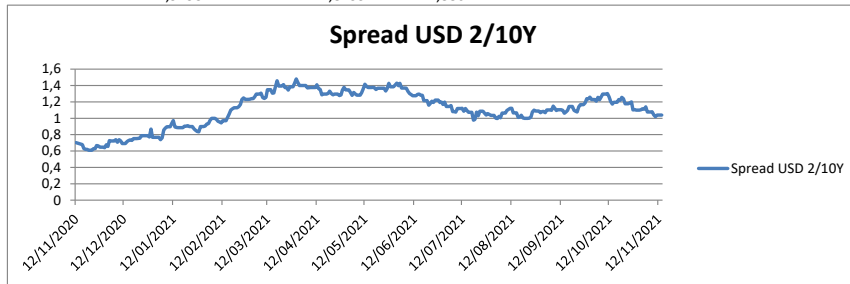
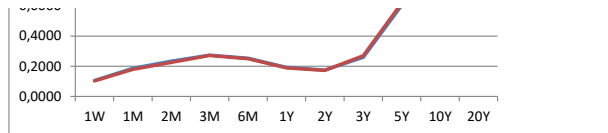
EURIBOR3M	15/11/2021	12/11/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,562						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC21	100,56	100,565	-0,560		101,120	-0,565	0,002
I MAR22	100,52	100,525	-0,520		101,040	-0,525	0,042
I JUN22	100,455	100,455	-0,455		100,910	-0,455	0,107
I SEP22	100,38	100,38	-0,380		100,760	-0,380	0,182
I DEC22	100,29	100,29	-0,290		100,580	-0,290	0,272
I MAR23	100,18	100,18	-0,180		100,360	-0,180	0,382
I JUN23	100,115	100,11	-0,115		100,230	-0,110	0,447
I SEP23	100,06	100,055	-0,060		100,120	-0,055	0,502
I DEC23	100,02	100,01	-0,020		100,040	-0,010	0,542
I MAR24	99,99	99,98	0,010		99,980	0,020	0,572
I JUN24	99,97	99,96	0,030		99,940	0,040	0,592
I SEP24	99,95	99,945	0,050		99,900	0,055	0,612



TAUX US EMPRUNTEUR	12/11/2021	11/11/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0760	0,0739	0,074
LIBOR USD 1M	0,0891	0,0895	0,090
LIBOR 2M USD	0,1189	0,1190	0,119
LIBOR 3M USD	0,1550	0,1560	0,156
LIBOR 6M USD	0,2260	0,2279	0,228
	12/11/2021	11/11/2021	



USA Benchmark 1Y	0,2446	0,2313	0,231
US Benchmark 2Y	0,4704	0,4590	0,459
US Benchmark 3Y	0,8145	0,7820	0,782
US Benchmark 5Y	1,2405	1,2144	1,214
US Benchmark 10Y	1,5095	1,4791	1,479
US Benchmark 20Y	1,9481	1,9050	1,905
US Benchmark 30Y	1,9293	1,8799	1,880



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	12/11/2021	11/11/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0398	0,0396	0,03963
Libor 1 Week/GBP	0,0396	0,0401	0,04013
LIBOR 1 Month/GBP	0,0553	0,0523	0,05225
LIBOR 2 Months/GBP	0,0789	0,0753	0,07525
LIBOR 3 Months/GBP	0,1085	0,1169	0,11688
LIBOR 6 Months/GBP	0,2988	0,3040	0,304
12/11/2021 11/11/2021			
UK Benchmark 1Y	0,3336	0,3688	0,368803
UK Benchmark 2Y	0,5516	0,5549	0,554862
UK Benchmark 3Y	0,6048	0,6152	0,615202
UK Benchmark 4Y	0,5809	0,5894	0,589416
UK Benchmark 5Y	0,6218	0,6377	0,637718
UK Benchmark 6Y	0,6840	0,6849	0,684916
UK Benchmark 7Y	0,7345	0,7198	0,719768
UK Benchmark 8Y	0,7968	0,7981	0,798148
UK Benchmark 9Y	0,8675	0,8412	0,841169
UK Benchmark 10Y	0,9071	0,8702	0,87019
UK Benchmark 12Y	0,9891	0,9917	0,9917
UK Benchmark 15Y	1,0461	1,0609	1,060873
UK Benchmark 20Y	1,1564	1,0768	1,07683

