

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,59%	1,59%	1,59	0,001
DE Benchmark 10Y	-0,24%	-0,25%	0,26	0,013
FR Benchmark 10Y	0,12%	0,11%	0,10	0,0185
FR Benchmark 5Y	-0,35%	-0,36%	0,36	0,010
UK Benchmark 10Y	0,89%	0,88%	0,86	0,032
TEC 10	0,1			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	77,45	78,36
Petrole Brut Baril	79,64	80,28
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,3528	2,3644
Gaz naturel	4,934	4,816
Or 1 Oc	1864,2	1867,63

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1331	1,1328
EUR/JPY	129,378	129,372
EUR/GBP	0,83981	0,83975
EUR/CAD	1,4294	1,429
EUR/CNY	7,2352	7,2268
EUR/BRL	6,269	6,2613

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,26	6,32	4,26	4,38
3 mois	27,55	27,8	16,87	17,22
6 mois	50,27	50,97	40,31	41,46

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,73	-0,43
Deposits EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposits EUR 2M	-0,76	-0,46
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	-0,486	16/11/2021
ECB ESTR Short Term	-0,571	17/11/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,571	16/11/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,563	16/11/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,558	16/11/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,53	16/11/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,484	16/11/2021

	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	100,565	100,57
I MAR22	100,52	100,525
I JUN22	100,48	100,485
I SEP22	100,415	100,42
I DEC22	100,33	100,335

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,582	-0,541
OIS EUR 3M	-0,59	-0,549
OIS EUR 6M	-0,59	-0,549
OIS EUR 1Y	-0,575	-0,534
OIS EUR 2Y	-0,481	-0,44
OIS EUR 3Y	-0,396	-0,355

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,575	-0,555
FRA EUR 2x5	-0,56	-0,54
FRA EUR 3x6	-0,545	-0,525
FRA EUR 6x9	-0,506	-0,486
FRA EUR 9x12	-0,455	-0,435
FRA EUR 3x9	-0,5	-0,48
FRA EUR 6x12	-0,451	-0,431
FRA EUR 9x15	-0,386	-0,366
FRA EUR 12x24	-0,19	-0,17

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

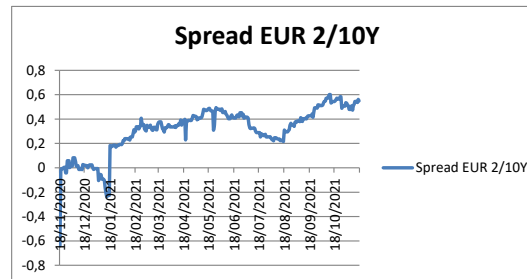
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5368	-0,4968

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

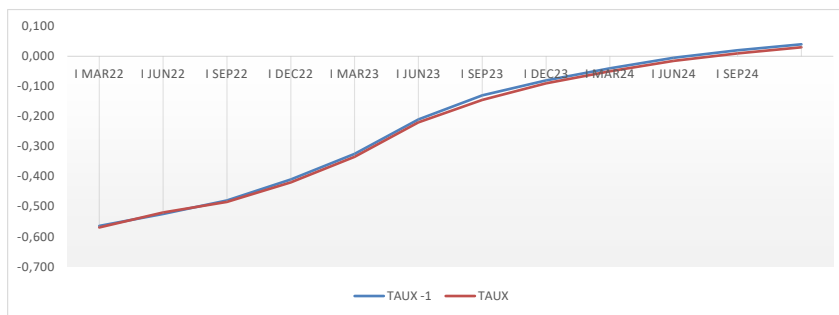
IRS EUR 2Y	-0,3928	-0,3528
IRS EUR 3Y	-0,2775	-0,2375
IRS EUR 4Y	-0,2023	-0,1623
IRS EUR 5Y	-0,1485	-0,1085
IRS EUR 6Y	-0,094	-0,054
IRS EUR 7Y	-0,0369	0,0031
IRS EUR 10Y	0,1346	0,1746



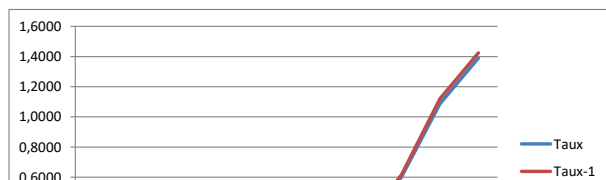
TAUX EURIBOR	16/11/2021	15/11/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,57	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,56	-0,56	0,003
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,53	-0,002
EURIBOR 12M EUR	-0,48	-0,48	-0,004
XEU Benchmark 2Y	17/11/2021	16/11/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,80	-0,80	0,004
XEU Benchmark 3Y	-0,76	-0,76	-0,002
XEU Benchmark 4Y	-0,73	-0,73	-0,008
XEU Benchmark 5Y	-0,60	-0,59	-0,007
XEU Benchmark 6Y	-0,53	-0,53	-0,007
XEU Benchmark 7Y	-0,48	-0,47	-0,006
XEU Benchmark 8Y	-0,10	-0,09	-0,001
XEU Benchmark 9Y	0,00	0,00	0,000
XEU Benchmark 10Y	-0,25	-0,24	-0,008
XEU Benchmark 12Y	0,27	0,27	-0,001
XEU Benchmark 15Y	-0,08	-0,07	-0,008
XEU Benchmark 20Y	-0,11	-0,10	-0,010
TEC 30	0,80	0,78	0,020



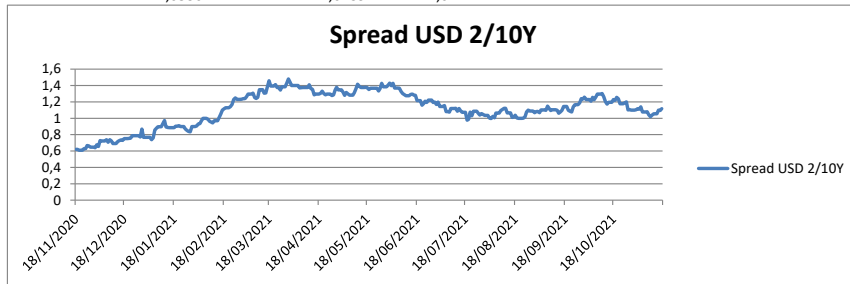
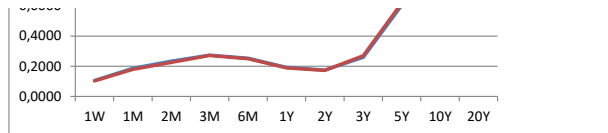
EURIBOR3M	18/11/2021	17/11/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,558						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC21	100,57	100,565	-0,570		101,140	-0,565	-0,012
I MAR22	100,52	100,525	-0,520		101,040	-0,525	0,038
I JUN22	100,485	100,48	-0,485		100,970	-0,480	0,073
I SEP22	100,42	100,41	-0,420		100,840	-0,410	0,138
I DEC22	100,335	100,325	-0,335		100,670	-0,325	0,223
I MAR23	100,22	100,21	-0,220		100,440	-0,210	0,338
I JUN23	100,145	100,13	-0,145		100,290	-0,130	0,413
I SEP23	100,09	100,08	-0,090		100,180	-0,080	0,468
I DEC23	100,05	100,04	-0,050		100,100	-0,040	0,508
I MAR24	100,015	100,005	-0,015		100,030	-0,005	0,543
I JUN24	99,99	99,98	0,010		99,980	0,020	0,568
I SEP24	99,97	99,96	0,030		99,940	0,040	0,588



TAUX US EMPRUNTEUR	16/11/2021	15/11/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0730	0,0743	0,074
LIBOR USD 1M	0,0889	0,0911	0,091
LIBOR 2M USD	0,1246	0,1195	0,120
LIBOR 3M USD	0,1600	0,1579	0,158
LIBOR 6M USD	0,2278	0,2254	0,225
	17/11/2021	16/11/2021	



USA Benchmark 1Y	0,2278	0,2295	0,230
US Benchmark 2Y	0,4649	0,4725	0,473
US Benchmark 3Y	0,7929	0,7956	0,796
US Benchmark 5Y	1,2484	1,2466	1,247
US Benchmark 10Y	1,5817	1,5681	1,568
US Benchmark 20Y	2,0605	2,0207	2,021
US Benchmark 30Y	2,0530	2,0139	2,014



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	16/11/2021	15/11/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0396	0,0400	0,04
Libor 1 Week/GBP	0,0396	0,0394	0,03938
LIBOR 1 Month/GBP	0,0555	0,0543	0,05425
LIBOR 2 Months/GBP	0,0803	0,0783	0,07825
LIBOR 3 Months/GBP	0,1086	0,1018	0,10175
LIBOR 6 Months/GBP	0,3120	0,2949	0,29488
	17/11/2021	16/11/2021	
UK Benchmark 1Y	0,3207	0,4283	0,42827
UK Benchmark 2Y	0,5510	0,5730	0,573031
UK Benchmark 3Y	0,6135	0,6336	0,63358
UK Benchmark 4Y	0,5922	0,6094	0,609362
UK Benchmark 5Y	0,6466	0,6769	0,676876
UK Benchmark 6Y	0,7056	0,7143	0,71433
UK Benchmark 7Y	0,7555	0,7659	0,765862
UK Benchmark 8Y	0,8491	0,8465	0,846483
UK Benchmark 9Y	0,9067	0,9125	0,912481
UK Benchmark 10Y	0,9821	0,9493	0,949316
UK Benchmark 12Y	1,0022	1,0334	1,033353
UK Benchmark 15Y	1,1176	1,1115	1,111541
UK Benchmark 20Y	1,2113	1,2051	1,205096

