

TAUX ET MATIERES PREMIERES

| LONGS ETATS | ACHAT | VENTE | ACHAT CLOSE | Δ |
|------------------|--------|--------|-------------|--------|
| US Benchmark 10Y | 1,48% | 1,48% | 1,53 | -0,046 |
| DE Benchmark 10Y | -0,33% | -0,34% | 0,33 | -0,008 |
| FR Benchmark 10Y | 0,04% | 0,03% | 0,04 | -0,002 |
| FR Benchmark 5Y | -0,42% | -0,43% | 0,40 | -0,018 |
| UK Benchmark 10Y | 0,73% | 0,73% | 0,73 | 0,000 |
| TEC 10 | 0,05 | | | |

| ENERGIE ET OR (USD) | Cours | Close |
|---------------------|----------|---------|
| Petrole Brut WTI | 71,46 | 68,15 |
| Petrole Brut Baril | 75,84 | 72,72 |
| Electricity NYHubZJ | 26,6 | 26,6 |
| Heating oil/fuel | 2,16 | 2,0945 |
| Gaz naturel | 5,093 | 5,477 |
| Or 1 Oc | 1794,855 | 1792,28 |

DEVICES

| Parités | VENTE | ACHAT |
|---------|---------|---------|
| EUR/USD | 1,1262 | 1,1261 |
| EUR/JPY | 127,918 | 127,912 |
| EUR/GBP | 0,8451 | 0,84489 |
| EUR/CAD | 1,43427 | 1,43414 |
| EUR/CNY | 7,1946 | 7,1864 |
| EUR/BRL | 6,3218 | 6,314 |

| Ppt de terme | EUR/USD | | EUR/GBP | |
|--------------|---------|-------|---------|-------|
| | VENTE | ACHAT | VENTE | ACHAT |
| 1 mois | 15,78 | 16,03 | 5,94 | 6,34 |
| 3 mois | 29,57 | 29,87 | 16,83 | 17,31 |
| 6 mois | 53,13 | 54,13 | 38,79 | 40,18 |

MARCHÉ MONÉTAIRE

| MARCHÉ MONÉTAIRE EUR | VENTE | ACHAT |
|----------------------|-------|-------|
| Deposits EUR ON | -0,73 | -0,43 |
| Deposits EUR 1M | -0,69 | -0,39 |
| Deposits EUR 2M | -0,77 | -0,47 |
| Deposits EUR 3M | -0,75 | -0,45 |
| Deposits EUR 6M | -0,67 | -0,37 |
| Deposits EUR 12M | -0,64 | -0,34 |

| FIXING | TAUX | DATE |
|---------------------|--------|------------|
| EONIA | -0,488 | 25/11/2021 |
| ECB ESTR Short Term | -0,573 | 26/11/2021 |
| EURIBOR 1W EUR | -0,569 | 26/11/2021 |
| EURIBOR 1M EUR | -0,567 | 26/11/2021 |
| EURIBOR 3M EUR | -0,572 | 26/11/2021 |
| EURIBOR 6M EUR | -0,537 | 26/11/2021 |
| EURIBOR 12M EUR | -0,494 | 26/11/2021 |

| | 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 | 100,57 | 100,575 |
| I MAR22 | 100,525 | 100,53 |
| I JUN22 | 100,495 | 100,5 |
| I SEP22 | 100,455 | 100,46 |
| I DEC22 | 100,395 | 100,4 |

| SWAP ESTER | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|------------|---------|------------|
| OIS EUR 1M | -0,602 | -0,561 |
| OIS EUR 3M | -0,6 | -0,559 |
| OIS EUR 6M | -0,596 | -0,555 |
| OIS EUR 1Y | -0,588 | -0,547 |
| OIS EUR 2Y | -0,526 | -0,485 |
| OIS EUR 3Y | -0,451 | -0,41 |

| FRA's | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------|---------|------------|
| FRA EUR 1x4 | -0,583 | -0,563 |
| FRA EUR 2x5 | -0,566 | -0,546 |
| FRA EUR 3x6 | -0,548 | -0,528 |
| FRA EUR 6x9 | -0,516 | -0,496 |
| FRA EUR 9x12 | -0,483 | -0,463 |
| FRA EUR 3x9 | -0,506 | -0,486 |
| FRA EUR 6x12 | -0,47 | -0,45 |
| FRA EUR 9x15 | -0,424 | -0,404 |
| FRA EUR 12x24 | -0,269 | -0,249 |

| 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 |

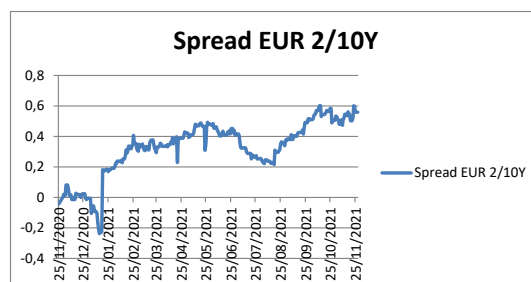
| SWAP EURIBOR 3 MOIS | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------------|---------|------------|
| IRS EUR 1Y | -0,5481 | -0,5081 |

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

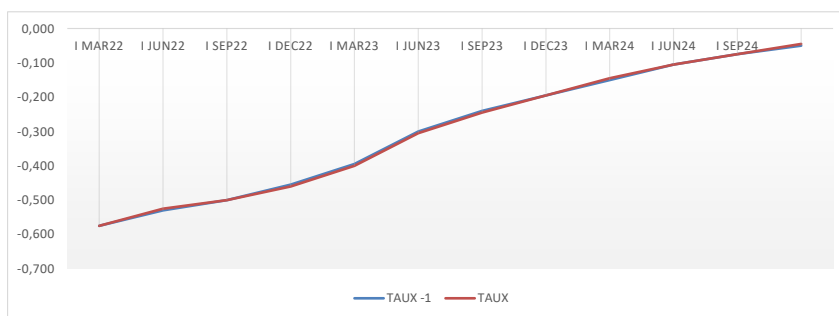
| | | |
|-------------|---------|---------|
| IRS EUR 2Y | -0,4359 | -0,3959 |
| IRS EUR 3Y | -0,3375 | -0,2975 |
| IRS EUR 4Y | -0,2609 | -0,2209 |
| IRS EUR 5Y | -0,2038 | -0,1638 |
| IRS EUR 6Y | -0,1499 | -0,1099 |
| IRS EUR 7Y | -0,0927 | -0,0527 |
| IRS EUR 10Y | 0,0903 | 0,1303 |



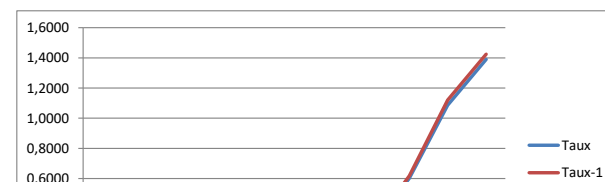
| TAUX EURIBOR | 26/11/2021 | 25/11/2021 | Δ |
|-------------------|------------|------------|--------|
| EURIBOR 1W EUR | -0,57 | -0,58 | 0,015 |
| EURIBOR 1M EUR | -0,57 | -0,57 | 0,001 |
| EURIBOR 3M EUR | -0,57 | -0,58 | 0,003 |
| EURIBOR 6M EUR | -0,54 | -0,54 | 0,005 |
| EURIBOR 12M EUR | -0,49 | -0,50 | 0,004 |
| XEU Benchmark 2Y | -0,82 | -0,81 | -0,017 |
| XEU Benchmark 3Y | -0,79 | -0,76 | -0,026 |
| XEU Benchmark 4Y | -0,77 | -0,72 | -0,050 |
| XEU Benchmark 5Y | -0,69 | -0,62 | -0,070 |
| XEU Benchmark 6Y | -0,60 | -0,53 | -0,070 |
| XEU Benchmark 7Y | -0,55 | -0,47 | -0,075 |
| XEU Benchmark 8Y | -0,17 | -0,09 | -0,077 |
| XEU Benchmark 9Y | -0,07 | 0,01 | -0,078 |
| XEU Benchmark 10Y | -0,33 | -0,25 | -0,084 |
| XEU Benchmark 12Y | 0,21 | 0,28 | -0,078 |
| XEU Benchmark 15Y | -0,14 | -0,07 | -0,073 |
| XEU Benchmark 20Y | -0,18 | -0,11 | -0,073 |
| TEC 30 | 0,75 | 0,83 | -0,080 |



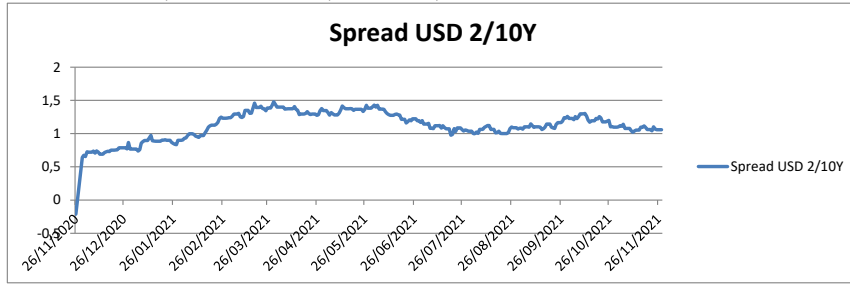
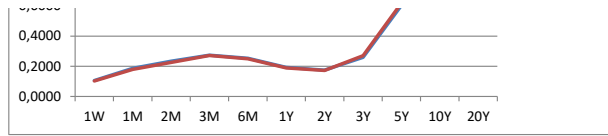
| EURIBOR3M | 29/11/2021 | 26/11/2021 | TAUX | Δ | TAUX VEILLE | Δ/FIX |
|-----------------------|------------|------------|--------|---|-------------|--------|
| EURIBOR 3M EUR | -0,572 | | | | | |
| LIFFE EURIBOR3M/ROLLS | | | | | | |
| I DEC21 | 100,575 | 100,575 | -0,575 | | 101,150 | -0,575 |
| I MAR22 | 100,525 | 100,53 | -0,525 | | 101,050 | -0,530 |
| I JUN22 | 100,5 | 100,5 | -0,500 | | 101,000 | -0,500 |
| I SEP22 | 100,46 | 100,455 | -0,460 | | 100,920 | -0,455 |
| I DEC22 | 100,4 | 100,395 | -0,400 | | 100,800 | -0,395 |
| I MAR23 | 100,305 | 100,3 | -0,305 | | 100,610 | -0,300 |
| I JUN23 | 100,245 | 100,24 | -0,245 | | 100,490 | -0,240 |
| I SEP23 | 100,195 | 100,195 | -0,195 | | 100,390 | -0,195 |
| I DEC23 | 100,145 | 100,15 | -0,145 | | 100,290 | -0,150 |
| I MAR24 | 100,105 | 100,105 | -0,105 | | 100,210 | -0,105 |
| I JUN24 | 100,075 | 100,075 | -0,075 | | 100,150 | -0,075 |
| I SEP24 | 100,045 | 100,05 | -0,045 | | 100,090 | -0,050 |



| TAUX US EMPRUNTEUR | 26/11/2021 | 25/11/2021 | Δ |
|--------------------|------------|------------|-------|
| Libor 1 Week/USD | 0,0761 | 0,0743 | 0,074 |
| LIBOR USD 1M | 0,0904 | 0,0930 | 0,093 |
| LIBOR 2M USD | 0,1410 | 0,1425 | 0,143 |
| LIBOR 3M USD | 0,1754 | 0,1756 | 0,176 |
| LIBOR 6M USD | 0,2460 | 0,2591 | 0,259 |



| | | | |
|------------------|--------|--------|-------|
| USA Benchmark 1Y | 0,3067 | 0,3960 | 0,396 |
| US Benchmark 2Y | 0,4182 | 0,5495 | 0,550 |
| US Benchmark 3Y | 0,7499 | 0,9036 | 0,904 |
| US Benchmark 5Y | 1,1641 | 1,3364 | 1,336 |
| US Benchmark 10Y | 1,4548 | 1,6078 | 1,608 |
| US Benchmark 20Y | 1,9026 | 2,0253 | 2,025 |
| US Benchmark 30Y | 1,8776 | 1,9822 | 1,982 |



TAUX UK EMPRUNTEUR 

| | 26/11/2021 | 25/11/2021 | Δ |
|--------------------|------------|------------|----------|
| LIBOR ON/GBP | 0,0378 | 0,0390 | 0,039 |
| Libor 1 Week/GBP | 0,0380 | 0,0380 | 0,038 |
| LIBOR 1 Month/GBP | 0,0623 | 0,0710 | 0,071 |
| LIBOR 2 Months/GBP | 0,0720 | 0,0828 | 0,08275 |
| LIBOR 3 Months/GBP | 0,1024 | 0,1196 | 0,11963 |
| LIBOR 6 Months/GBP | 0,2733 | 0,3078 | 0,30775 |
| 26/11/2021 | | | |
| UK Benchmark 1Y | 0,1862 | 0,2294 | 0,229403 |
| UK Benchmark 2Y | 0,4186 | 0,5397 | 0,539692 |
| UK Benchmark 3Y | 0,4909 | 0,6077 | 0,607663 |
| UK Benchmark 4Y | 0,4627 | 0,5806 | 0,580557 |
| UK Benchmark 5Y | 0,5405 | 0,6643 | 0,664321 |
| UK Benchmark 6Y | 0,5646 | 0,7089 | 0,70894 |
| UK Benchmark 7Y | 0,6140 | 0,7651 | 0,765134 |
| UK Benchmark 8Y | 0,6830 | 0,8438 | 0,843772 |
| UK Benchmark 9Y | 0,7519 | 0,8995 | 0,899539 |
| UK Benchmark 10Y | 0,8374 | 0,9904 | 0,990443 |
| UK Benchmark 12Y | 0,8471 | 0,9933 | 0,993334 |
| UK Benchmark 15Y | 0,9659 | 1,0996 | 1,099636 |
| UK Benchmark 20Y | 1,0491 | 1,1764 | 1,176375 |

