

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,46%	1,46%	1,47	-0,008
DE Benchmark 10Y	-0,31%	-0,31%	0,31	0,006
FR Benchmark 10Y	0,06%	0,05%	0,06	0
FR Benchmark 5Y	-0,37%	-0,38%	0,37	0,004
UK Benchmark 10Y	0,80%	0,79%	0,80	0,000
TEC 10	0			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	71,23	71,12
Petrole Brut Baril	73,95	73,98
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,2555	2,2578
Gaz naturel	3,883	3,869
Or 1 Oc	1786,855	1788,8

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1266	1,1263
EUR/JPY	128,589	128,583
EUR/GBP	0,84992	0,84987
EUR/CAD	1,45451	1,45435
EUR/CNY	7,1824	7,1744
EUR/BRL	6,476	6,4696

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	8,75	9,5	5,62	6,77
3 mois	22,77	23,52	19,04	20,18
6 mois	49,94	51,44	45,88	47,98

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,67	-0,37
Deposît EUR 1M	-0,7	-0,4
Deposît EUR 2M	-0,76	-0,46
Deposît EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposît EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 12M	-0,66	-0,36

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,491	17/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,571	21/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,574	20/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,625	20/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,588	20/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,554	20/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,518	20/12/2021

	30/11/2021	31/10/2021
TMO	0,35	0,43
TME	0,15	0,23
TMM	-0,4879	-0,4859
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,565	-0,56
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,567	-0,55

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I MAR22	100,54	100,545
I JUN22	100,505	100,51
I SEP22	100,445	100,45
I DEC22	100,38	100,385

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,607	-0,566
OIS EUR 3M	-0,6	-0,559
OIS EUR 6M	-0,593	-0,552
OIS EUR 1Y	-0,577	-0,536
OIS EUR 2Y	-0,491	-0,45
OIS EUR 3Y	-0,401	-0,36

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,575	-0,555
FRA EUR 2x5	-0,557	-0,537
FRA EUR 3x6		
FRA EUR 6x9	-0,514	-0,494
FRA EUR 9x12	-0,461	-0,441
FRA EUR 3x9	-0,506	-0,486
FRA EUR 6x12	-0,46	-0,44
FRA EUR 9x15	-0,395	-0,375
FRA EUR 12x24	-0,213	-0,193

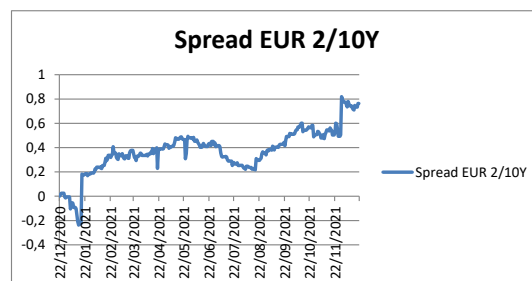
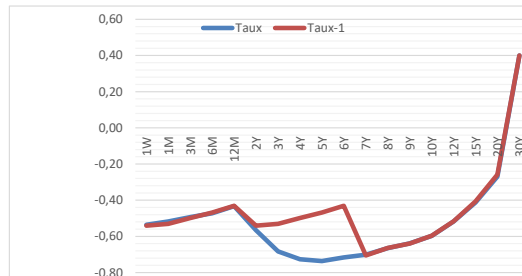
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

SWAP EURIBOR 6 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,3861	-0,3461
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

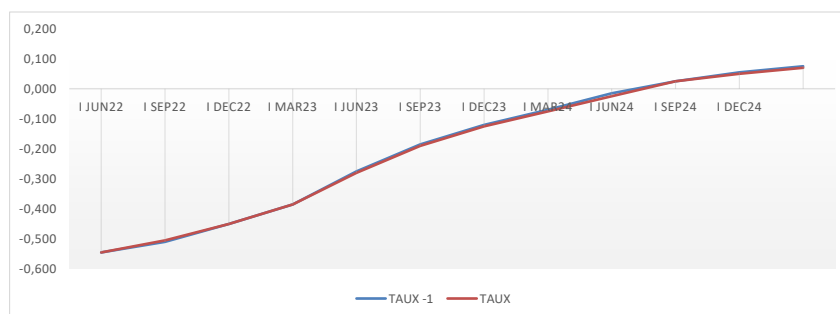
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5457	-0,5057
IRS EUR 2Y	-0,406	-0,366
IRS EUR 3Y	-0,2875	-0,2475
IRS EUR 4Y	-0,2138	-0,1738
IRS EUR 5Y	-0,153	-0,113
IRS EUR 6Y	-0,0991	-0,0591
IRS EUR 7Y	-0,0441	-0,0041
IRS EUR 10Y	0,1262	0,1662



TAUX EURIBOR	20/12/2021	17/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,59	0,014
EURIBOR 1M EUR	-0,63	-0,61	-0,014
EURIBOR 3M EUR	-0,59	-0,58	-0,007
EURIBOR 6M EUR	-0,55	-0,55	-0,003
EURIBOR 12M EUR	-0,52	-0,51	-0,007
XEU Benchmark 2Y	-0,77	-0,76	-0,014
XEU Benchmark 3Y	-0,75	-0,74	-0,009
XEU Benchmark 4Y	-0,73	-0,73	-0,004
XEU Benchmark 5Y	-0,42	-0,47	0,047
XEU Benchmark 6Y	-0,58	-0,58	0,004
XEU Benchmark 7Y	-0,54	-0,55	0,006
XEU Benchmark 8Y	-0,20	-0,21	0,008
XEU Benchmark 9Y	-0,03	-0,10	0,073
XEU Benchmark 10Y	-0,01	-0,03	0,015
XEU Benchmark 12Y	0,15	0,14	0,017
XEU Benchmark 15Y	-0,16	-0,18	0,019
XEU Benchmark 20Y	-0,13	-0,20	0,074
TEC 30	0,70	0,64	0,060

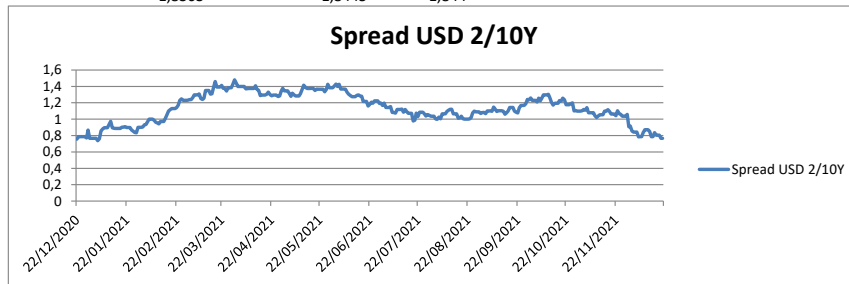
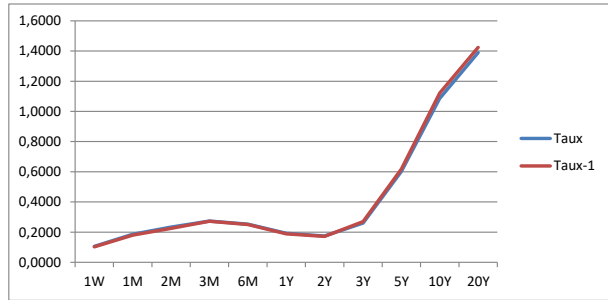


EURIBOR3M	22/12/2021	21/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,588						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I MAR22	100,545	100,545	-0,545		101,090	-0,545	0,043
I JUN22	100,505	100,51	-0,505		101,010	-0,510	0,083
I SEP22	100,45	100,45	-0,450		100,900	-0,450	0,138
I DEC22	100,385	100,385	-0,385		100,770	-0,385	0,203
I MAR23	100,28	100,275	-0,280		100,560	-0,275	0,308
I JUN23	100,19	100,185	-0,190		100,380	-0,185	0,398
I SEP23	100,125	100,12	-0,125		100,250	-0,120	0,463
I DEC23	100,075	100,07	-0,075		100,150	-0,070	0,513
I MAR24	100,025	100,015	-0,025		100,050	-0,015	0,563
I JUN24	99,975	99,975	0,025		99,950	0,025	0,613
I SEP24	99,95	99,945	0,050		99,900	0,055	0,638
I DEC24	99,93	99,925	0,070		99,860	0,075	0,658



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	20/12/2021	17/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0736	0,0764	0,076
LIBOR USD 1M	0,1035	0,1025	0,103
LIBOR 2M USD	0,1443	0,1484	0,148
LIBOR 3M USD	0,2143	0,2126	0,213
LIBOR 6M USD	0,3166	0,3128	0,313
	<b>20/12/2021</b>	<b>17/12/2021</b>	
USA Benchmark 1Y	0,2947	0,2995	0,300
US Benchmark 2Y	0,6315	0,6507	0,651
US Benchmark 3Y	0,8776	0,9034	0,903
US Benchmark 5Y	1,1831	1,2437	1,244
US Benchmark 10Y	1,3977	1,4543	1,454
US Benchmark 20Y	1,8696	1,8825	1,882
US Benchmark 30Y	1,8363	1,8445	1,844



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	20/12/2021	17/12/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,1846	0,1748	0,17475
Libor 1 Week/GBP	0,1849	0,1859	0,18588
LIBOR 1 Month/GBP	0,1748	0,1791	0,17913
LIBOR 2 Months/GBP	0,2008	0,1838	0,18375
LIBOR 3 Months/GBP	0,2356	0,2218	0,22175
LIBOR 6 Months/GBP	0,4170	0,3944	0,39438
	<b>20/12/2021</b>	<b>17/12/2021</b>	
UK Benchmark 1Y	0,2009	0,3881	0,388145
UK Benchmark 2Y	0,5631	0,5280	0,528026
UK Benchmark 3Y	0,6823	0,5966	0,596647
UK Benchmark 4Y	0,5386	0,5254	0,5254
UK Benchmark 5Y	0,6481	0,6318	0,631807
UK Benchmark 6Y	0,5886	0,5795	0,579507
UK Benchmark 7Y	0,6805	0,6701	0,670141
UK Benchmark 8Y	0,7630	0,6594	0,659423
UK Benchmark 9Y	0,7070	0,7008	0,700813
UK Benchmark 10Y	0,7756	0,7585	0,758491
UK Benchmark 12Y	0,9113	0,7948	0,794821
UK Benchmark 15Y	1,0429	0,9394	0,939381
UK Benchmark 20Y	1,0293	1,0326	1,032644

