

TAUX ET MATIERES PREMIERES

| LONGS ETATS | ACHAT | VENTE | ACHAT CLOSE | Δ |
|------------------|--------|--------|-------------|-------|
| US Benchmark 10Y | 1,50% | 1,49% | 1,48 | 0,011 |
| DE Benchmark 10Y | -0,25% | -0,26% | 0,25 | 0,000 |
| FR Benchmark 10Y | 0,12% | 0,12% | 0,12 | 0 |
| FR Benchmark 5Y | -0,32% | -0,33% | 0,32 | 0,000 |
| UK Benchmark 10Y | 0,85% | 0,84% | 0,85 | 0,000 |
| TEC 10 | 0,1 | | | |

| ENERGIE ET OR (USD) | Cours | Close |
|---------------------|-----------|--------|
| Petrole Brut WTI | 72,97 | 73,79 |
| Petrole Brut Baril | 76,04 | 76,14 |
| Electricity NYHubZJ | 26,6 | 26,6 |
| Heating oil/fuel | 2,3005 | 2,3069 |
| Gaz naturel | 3,824 | 3,731 |
| Or 1 Oc | 1808,8405 | 1808,4 |

DEVISES

| Parités | VENTE | ACHAT |
|---------|---------|---------|
| EUR/USD | 1,1325 | 1,1322 |
| EUR/JPY | 129,71 | 129,704 |
| EUR/GBP | 0,84434 | 0,84429 |
| EUR/CAD | 1,45187 | 1,45171 |
| EUR/CNY | 7,2198 | 7,2122 |
| EUR/BRL | 6,4308 | 6,4235 |

| Pt de terme | EUR/USD | | EUR/GBP | |
|-------------|---------|-------|---------|-------|
| | VENTE | ACHAT | VENTE | ACHAT |
| 1 mois | 9,25 | 10,3 | 5,05 | 6,87 |
| 3 mois | 23,1 | 24,15 | 18,86 | 20,68 |
| 6 mois | 51,35 | 52,85 | 46,1 | 48,9 |

MARCHÉ MONÉTAIRE

| MARCHÉ MONÉTAIRE EUR | VENTE | ACHAT |
|----------------------|-------|-------|
| Deposits EUR ON | -0,67 | -0,37 |
| Deposits EUR 1M | -0,8 | -0,5 |
| Deposits EUR 2M | -0,73 | -0,43 |
| Deposits EUR 3M | -0,71 | -0,41 |
| Deposits EUR 6M | -0,7 | -0,4 |
| Deposits EUR 12M | -0,68 | -0,38 |

| FIXING | TAUX | DATE |
|---------------------|--------|------------|
| EONIA | -0,491 | 23/12/2021 |
| ECB ESTR Short Term | -0,58 | 24/12/2021 |
| EURIBOR 1W EUR | -0,579 | 24/12/2021 |
| EURIBOR 1M EUR | -0,621 | 24/12/2021 |
| EURIBOR 3M EUR | -0,587 | 24/12/2021 |
| EURIBOR 6M EUR | -0,544 | 24/12/2021 |
| EURIBOR 12M EUR | -0,494 | 24/12/2021 |

| | 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 | 100,495 | 100,5 |
| I SEP22 | 100,415 | 100,42 |
| I DEC22 | 100,33 | 100,335 |

| SWAP ESTER | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|------------|---------|------------|
| OIS EUR 1M | -0,606 | -0,565 |
| OIS EUR 3M | -0,599 | -0,558 |
| OIS EUR 6M | -0,592 | -0,551 |
| OIS EUR 1Y | -0,566 | -0,525 |
| OIS EUR 2Y | -0,446 | -0,405 |
| OIS EUR 3Y | -0,338 | -0,297 |

| FRA's | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------|---------|------------|
| FRA EUR 1x4 | | |
| FRA EUR 2x5 | | |
| FRA EUR 3x6 | | |
| FRA EUR 6x9 | | |
| FRA EUR 9x12 | | |
| FRA EUR 3x9 | | |
| FRA EUR 6x12 | | |
| FRA EUR 9x15 | | |
| FRA EUR 12x24 | | |

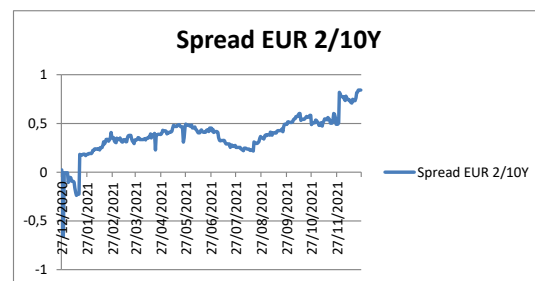
| SWAP EURIBOR 1 MOIS | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------------|---------|------------|
| IRS EUR 3M | -0,473 | -0,453 |
| IRS EUR 6M | -0,481 | -0,461 |
| IRS EUR 1Y | -0,491 | -0,471 |
| IRS 2Y Ac/360v1M FI | -0,504 | -0,484 |
| IRS 3Y Ac/360v1M FI | -0,511 | -0,491 |

| 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 |

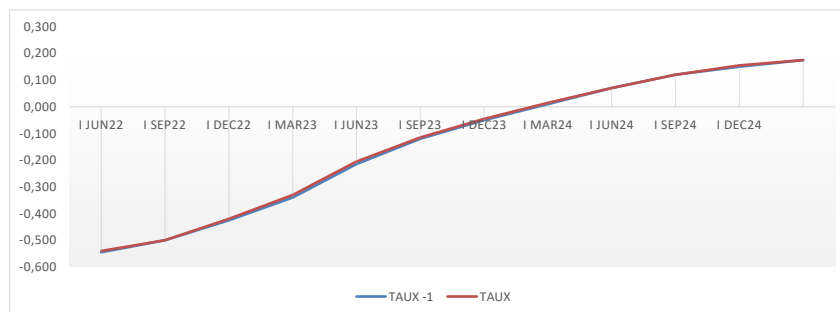
| SWAP EURIBOR 3 MOIS | PRETEUR | EMPRUNTEUR |
|---------------------|---------|------------|
| IRS EUR 1Y | -0,5354 | -0,4954 |
| IRS EUR 2Y | -0,3665 | -0,3265 |
| IRS EUR 3Y | -0,2428 | -0,2028 |
| IRS EUR 4Y | -0,1642 | -0,1242 |
| IRS EUR 5Y | -0,0934 | -0,0534 |
| IRS EUR 6Y | -0,0388 | 0,0012 |
| IRS EUR 7Y | 0,0164 | 0,0564 |
| IRS EUR 10Y | 0,1891 | 0,2291 |



| TAUX EURIBOR | 24/12/2021 | 23/12/2021 | Δ |
|-------------------|------------|------------|--------|
| EURIBOR 1W EUR | -0,58 | -0,58 | -0,001 |
| EURIBOR 1M EUR | -0,62 | -0,65 | 0,027 |
| EURIBOR 3M EUR | -0,59 | -0,59 | 0,001 |
| EURIBOR 6M EUR | -0,54 | -0,54 | -0,007 |
| EURIBOR 12M EUR | -0,49 | -0,50 | 0,005 |
| XEU Benchmark 2Y | -0,73 | -0,72 | -0,007 |
| XEU Benchmark 3Y | -0,69 | -0,71 | 0,020 |
| XEU Benchmark 4Y | -0,65 | -0,65 | 0,002 |
| XEU Benchmark 5Y | -0,37 | -0,37 | 0,000 |
| XEU Benchmark 6Y | -0,47 | -0,48 | 0,006 |
| XEU Benchmark 7Y | -0,43 | -0,44 | 0,005 |
| XEU Benchmark 8Y | -0,08 | -0,08 | 0,000 |
| XEU Benchmark 9Y | 0,02 | 0,02 | -0,001 |
| XEU Benchmark 10Y | 0,12 | 0,12 | 0,000 |
| XEU Benchmark 12Y | 0,29 | 0,29 | 0,000 |
| XEU Benchmark 15Y | -0,04 | -0,05 | 0,007 |
| XEU Benchmark 20Y | -0,07 | -0,08 | 0,010 |
| TEC 30 | 0,81 | 0,81 | 0,000 |

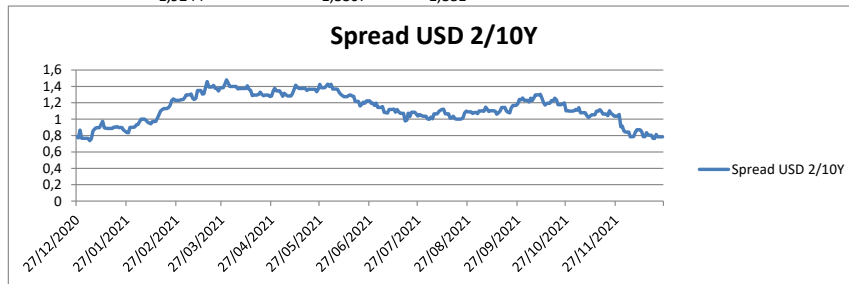
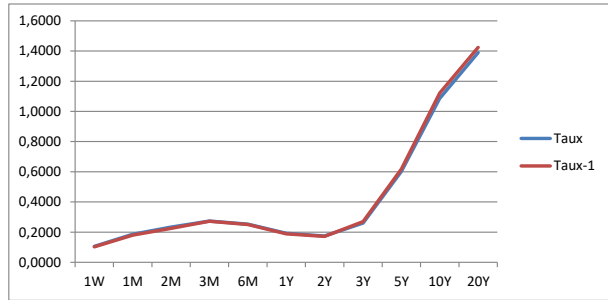


| EURIBOR3M | 27/12/2021 | 24/12/2021 | TAUX | Δ | TAUX VEILLE | Δ/FIX |
|-----------------------|------------|------------|--------|---|-------------|--------|
| EURIBOR 3M EUR | -0,587 | | | | | |
| LIFFE EURIBOR3M/ROLLS | | | | | | |
| I MAR22 | 100,54 | 100,545 | -0,540 | | 101,080 | -0,545 |
| I JUN22 | 100,5 | 100,5 | -0,500 | | 101,000 | -0,500 |
| I SEP22 | 100,42 | 100,425 | -0,420 | | 100,840 | -0,425 |
| I DEC22 | 100,33 | 100,34 | -0,330 | | 100,660 | -0,340 |
| I MAR23 | 100,205 | 100,215 | -0,205 | | 100,410 | -0,215 |
| I JUN23 | 100,115 | 100,12 | -0,115 | | 100,230 | -0,120 |
| I SEP23 | 100,045 | 100,05 | -0,045 | | 100,090 | -0,050 |
| I DEC23 | 99,985 | 99,99 | 0,015 | | 99,970 | 0,010 |
| I MAR24 | 99,93 | 99,93 | 0,070 | | 99,860 | 0,070 |
| I JUN24 | 99,88 | 99,88 | 0,120 | | 99,760 | 0,120 |
| I SEP24 | 99,845 | 99,85 | 0,155 | | 99,690 | 0,150 |
| I DEC24 | 99,825 | 99,825 | 0,175 | | 99,650 | 0,175 |



TAUX US EMPRUNTEUR 

| | 23/12/2021 | 22/12/2021 | Δ |
|------------------|-------------------|-------------------|-------|
| Libor 1 Week/USD | 0,0751 | 0,0719 | 0,072 |
| LIBOR USD 1M | 0,1019 | 0,1028 | 0,103 |
| LIBOR 2M USD | 0,1556 | 0,1549 | 0,155 |
| LIBOR 3M USD | 0,2198 | 0,2114 | 0,211 |
| LIBOR 6M USD | 0,3364 | 0,3264 | 0,326 |
| | 23/12/2021 | 22/12/2021 | |
| USA Benchmark 1Y | 0,3315 | 0,3245 | 0,324 |
| US Benchmark 2Y | 0,7135 | 0,6962 | 0,696 |
| US Benchmark 3Y | 0,9729 | 0,9622 | 0,962 |
| US Benchmark 5Y | 1,2898 | 1,2961 | 1,296 |
| US Benchmark 10Y | 1,4972 | 1,5103 | 1,510 |
| US Benchmark 20Y | 1,9398 | 1,9074 | 1,907 |
| US Benchmark 30Y | 1,9244 | 1,8807 | 1,881 |



TAUX UK EMPRUNTEUR 

| | 23/12/2021 | 22/12/2021 | Δ |
|--------------------|-------------------|-------------------|----------|
| LIBOR ON/GBP | 0,1863 | 0,1870 | 0,187 |
| Libor 1 Week/GBP | 0,1856 | 0,1853 | 0,18525 |
| LIBOR 1 Month/GBP | 0,1744 | 0,1784 | 0,17838 |
| LIBOR 2 Months/GBP | 0,2236 | 0,2205 | 0,2205 |
| LIBOR 3 Months/GBP | 0,2399 | 0,2385 | 0,2385 |
| LIBOR 6 Months/GBP | 0,4683 | 0,4486 | 0,44863 |
| | 23/12/2021 | 22/12/2021 | |
| UK Benchmark 1Y | 0,5650 | 0,5458 | 0,545771 |
| UK Benchmark 2Y | 0,6998 | 0,6557 | 0,655676 |
| UK Benchmark 3Y | 0,7572 | 0,7202 | 0,720238 |
| UK Benchmark 4Y | 0,7045 | 0,6615 | 0,661523 |
| UK Benchmark 5Y | 0,7891 | 0,7590 | 0,758991 |
| UK Benchmark 6Y | 0,7563 | 0,7132 | 0,713247 |
| UK Benchmark 7Y | 0,8504 | 0,8003 | 0,800315 |
| UK Benchmark 8Y | 0,8197 | 0,7787 | 0,778672 |
| UK Benchmark 9Y | 0,8762 | 0,8291 | 0,829118 |
| UK Benchmark 10Y | 0,9351 | 0,9135 | 0,913463 |
| UK Benchmark 12Y | 0,9498 | 0,9454 | 0,945384 |
| UK Benchmark 15Y | 1,0892 | 1,0553 | 1,055315 |
| UK Benchmark 20Y | 1,1885 | 1,1514 | 1,151415 |

