

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,49%	1,48%	1,48	0,008
DE Benchmark 10Y	-0,25%	-0,26%	0,23	-0,018
FR Benchmark 10Y	0,12%	0,12%	0,14	-0,0142
FR Benchmark 5Y	-0,32%	-0,33%	0,28	-0,033
UK Benchmark 10Y	0,85%	0,84%	0,85	0,000
TEC 10	0,1			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	76,15	75,98
Petrole Brut Baril	79,2	78,94
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,378	2,3714
Gaz naturel	4,14	4,055
Or 1 Oc	1804,735	1806,285

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1302	1,13
EUR/JPY	129,875	129,869
EUR/GBP	0,84207	0,84202
EUR/CAD	1,4494	1,4484
EUR/CNY	7,2042	7,1961
EUR/BRL	6,3648	6,3571

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	8,13	9,53	4,67	6,66
3 mois	22,37	23,77	18,34	20,32
6 mois	50,58	52,58	45,09	48,16

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposít EUR ON	-0,67	-0,37
Deposít EUR 1M	-0,8	-0,5
Deposít EUR 2M	-0,73	-0,43
Deposít EUR 3M	-0,71	-0,41
Deposít EUR 6M	-0,7	-0,4
Deposít EUR 12M	-0,68	-0,38

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,495	24/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,575	28/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,589	27/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,614	27/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,59	27/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,544	27/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,495	27/12/2021

	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	100,545	100,55
I JUN22	100,495	100,5
I SEP22	100,41	100,415
I DEC22	100,315	100,32

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,6	-0,559
OIS EUR 3M	-0,596	-0,555
OIS EUR 6M	-0,591	-0,55
OIS EUR 1Y	-0,562	-0,521
OIS EUR 2Y	-0,434	-0,393
OIS EUR 3Y	-0,321	-0,28

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,577	-0,557
FRA EUR 2x5	-0,561	-0,541
FRA EUR 3x6	-0,548	-0,528
FRA EUR 6x9	-0,493	-0,473
FRA EUR 9x12	-0,413	-0,393
FRA EUR 3x9	-0,496	-0,476
FRA EUR 6x12	-0,425	-0,405
FRA EUR 9x15	-0,332	-0,312
FRA EUR 12x24	-0,109	-0,089

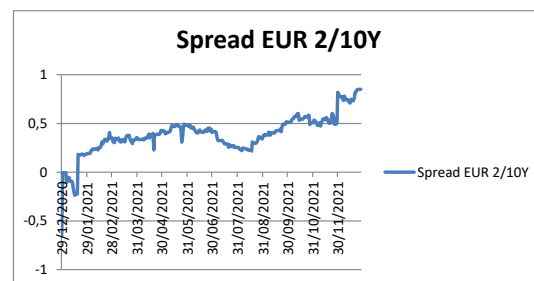
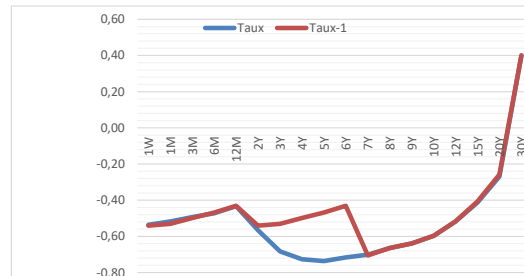
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

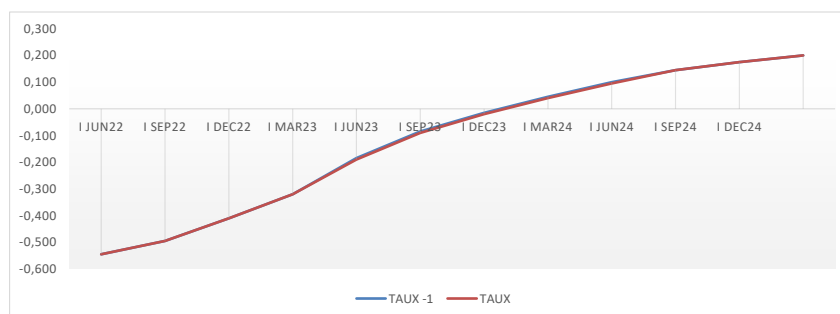
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5261	-0,4861
IRS EUR 2Y	-0,3435	-0,3035
IRS EUR 3Y	-0,2215	-0,1815
IRS EUR 4Y	-0,1394	-0,0994
IRS EUR 5Y	-0,0633	-0,0233
IRS EUR 6Y	-0,0114	0,0286
IRS EUR 7Y	0,0408	0,0808
IRS EUR 10Y	0,2057	0,2457



TAUX EURIBOR	27/12/2021	24/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,59	-0,58	-0,010
EURIBOR 1M EUR	-0,61	-0,62	0,007
EURIBOR 3M EUR	-0,59	-0,59	-0,003
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,54	0,000
EURIBOR 12M EUR	-0,50	-0,49	-0,001
	27/12/2021	24/12/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,71	-0,73	0,024
XEU Benchmark 3Y	-0,67	-0,69	0,018
XEU Benchmark 4Y	-0,63	-0,65	0,017
XEU Benchmark 5Y	-0,34	-0,35	0,012
XEU Benchmark 6Y	-0,46	-0,47	0,009
XEU Benchmark 7Y	-0,43	-0,43	0,006
XEU Benchmark 8Y	-0,06	-0,08	0,023
XEU Benchmark 9Y	0,04	0,05	-0,007
XEU Benchmark 10Y	0,14	0,12	0,026
XEU Benchmark 12Y	0,32	0,29	0,026
XEU Benchmark 15Y	-0,05	-0,04	-0,006
XEU Benchmark 20Y	-0,09	-0,09	0,001
TEC 30	0,81	0,81	0,000

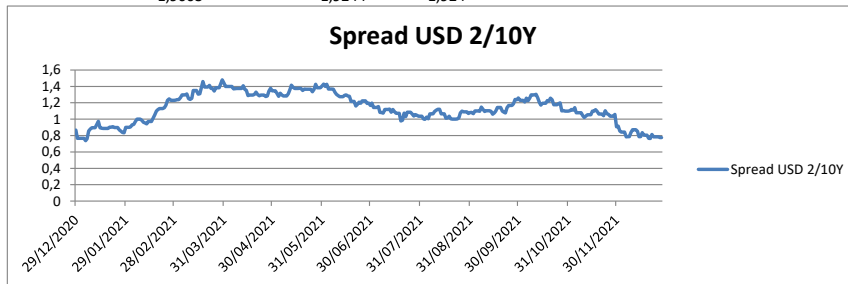
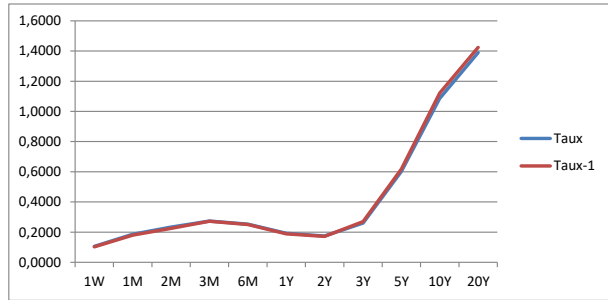


EURIBOR3M	29/12/2021	28/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,59					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,545	100,545	-0,545		101,090	-0,545
I JUN22	100,495	100,495	-0,495		100,990	-0,495
I SEP22	100,41	100,41	-0,410		100,820	-0,410
I DEC22	100,32	100,32	-0,320		100,640	-0,320
I MAR23	100,19	100,185	-0,190		100,380	-0,185
I JUN23	100,09	100,085	-0,090		100,180	-0,085
I SEP23	100,02	100,015	-0,020		100,040	-0,015
I DEC23	99,96	99,955	0,040		99,920	0,045
I MAR24	99,905	99,9	0,095		99,810	0,100
I JUN24	99,855	99,855	0,145		99,710	0,145
I SEP24	99,825	99,825	0,175		99,650	0,175
I DEC24	99,8	99,8	0,200		99,600	0,200



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
	27/12/2021	23/12/2021	
USA Benchmark 1Y	0,3491	0,3315	0,332
US Benchmark 2Y	0,7424	0,7135	0,713
US Benchmark 3Y	0,9897	0,9729	0,973
US Benchmark 5Y	1,3067	1,2898	1,290
US Benchmark 10Y	1,5171	1,4972	1,497
US Benchmark 20Y	1,9299	1,9398	1,940
US Benchmark 30Y	1,9003	1,9244	1,924



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
	27/12/2021	23/12/2021	
UK Benchmark 1Y	0,5603	0,5650	0,565045
UK Benchmark 2Y	0,6446	0,6998	0,699795
UK Benchmark 3Y	0,7281	0,7281	0,728148
UK Benchmark 4Y	0,6734	0,7045	0,704514
UK Benchmark 5Y	0,7847	0,7891	0,789104
UK Benchmark 6Y	0,7300	0,7563	0,756315
UK Benchmark 7Y	0,8362	0,8504	0,850396
UK Benchmark 8Y	0,8143	0,8143	0,814323
UK Benchmark 9Y	0,8527	0,8762	0,876234
UK Benchmark 10Y	0,9144	0,9351	0,935081
UK Benchmark 12Y	0,9838	0,9769	0,976885
UK Benchmark 15Y	1,0657	1,0657	1,065742
UK Benchmark 20Y	1,1620	1,1885	1,188466

