

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,45%	1,45%	1,47	-0,024
DE Benchmark 10Y	-0,35%	-0,36%	0,33	-0,018
FR Benchmark 10Y	0,02%	0,01%	0,03	-0,0099
FR Benchmark 5Y	-0,40%	-0,41%	0,39	-0,016
UK Benchmark 10Y	0,72%	0,71%	0,72	0,000
TEC 10	0,01			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	68,49	66,18
Petrole Brut Baril	71,87	70,57
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,128	2,0603
Gaz naturel	4,397	4,567
Or 1 Oc	1783,435	1774,88

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1355	1,1352
EUR/JPY	128,688	128,681
EUR/GBP	0,8526	0,85234
EUR/CAD	1,44806	1,44789
EUR/CNY	7,233	7,2248
EUR/BRL	6,3904	6,3832

Pnt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	16,04	16,28	5,02	5,43
3 mois	30,34	30,59	16,4	16,84
6 mois	54,67	55,67	40,08	41,48

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,7	-0,4
Deposits EUR 1M	-0,7	-0,4
Deposits EUR 2M	-0,76	-0,46
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 12M	-0,66	-0,36

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,488	26/11/2021
ECB ESTR Short Term	-0,573	29/11/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,578	29/11/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,563	29/11/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,57	29/11/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,536	29/11/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,504	29/11/2021

	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	100,575	100,58
I MAR22	100,53	100,535
I JUN22	100,48	100,485
I SEP22	100,43	100,435
I DEC22	100,36	100,365

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,6	-0,559
OIS EUR 3M	-0,597	-0,556
OIS EUR 6M	-0,578	-0,537
OIS EUR 1Y	-0,532	-0,491
OIS EUR 2Y	-0,405	-0,364
OIS EUR 3Y	-0,293	-0,252

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,589	-0,569
FRA EUR 2x5	-0,572	-0,552
FRA EUR 3x6	-0,553	-0,533
FRA EUR 6x9	-0,502	-0,482
FRA EUR 9x12	-0,453	-0,433
FRA EUR 3x9	-0,501	-0,481
FRA EUR 6x12	-0,449	-0,429
FRA EUR 9x15	-0,39	-0,369
FRA EUR 12x24	-0,221	-0,2

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

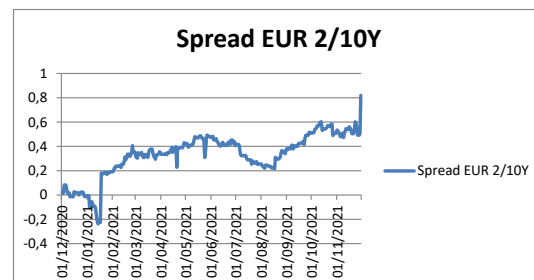
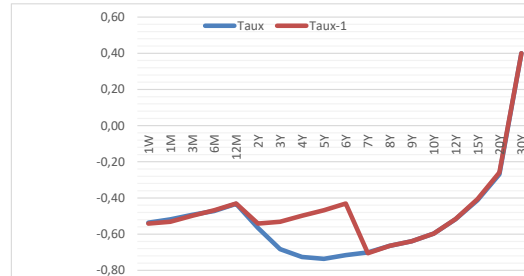
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5385	-0,4985

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

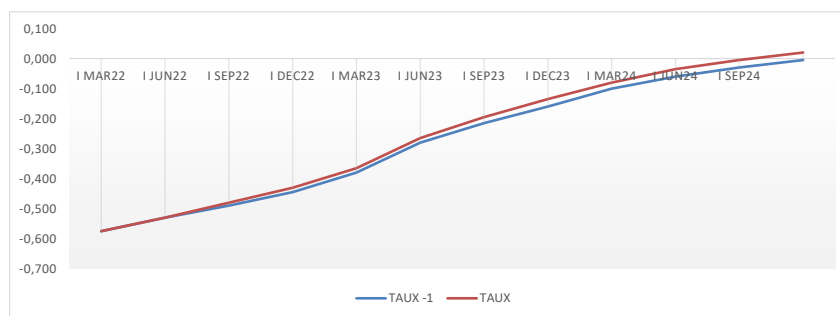
IRS EUR 2Y	-0,407	-0,367
IRS EUR 3Y	-0,3068	-0,2668
IRS EUR 4Y	-0,2248	-0,1848
IRS EUR 5Y	-0,1593	-0,1193
IRS EUR 6Y	-0,1107	-0,0707
IRS EUR 7Y	-0,0587	-0,0187
IRS EUR 10Y	0,104	0,144



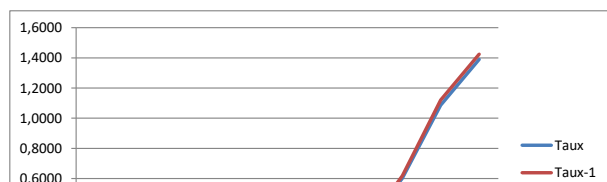
TAUX EURIBOR	29/11/2021	26/11/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,009
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,57	0,004
EURIBOR 3M EUR	-0,57	-0,57	0,002
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,54	0,001
EURIBOR 12M EUR	-0,50	-0,49	-0,010
30/11/2021			
XEU Benchmark 2Y	-0,80	-0,81	0,014
XEU Benchmark 3Y	-0,78	-0,77	-0,014
XEU Benchmark 4Y	-0,75	-0,75	0,002
XEU Benchmark 5Y	-0,45	-0,66	0,214
XEU Benchmark 6Y	-0,57	-0,58	0,006
XEU Benchmark 7Y	-0,54	-0,52	-0,020
XEU Benchmark 8Y	-0,17	-0,16	-0,012
XEU Benchmark 9Y	-0,07	-0,06	-0,017
XEU Benchmark 10Y	0,02	-0,31	0,329
XEU Benchmark 12Y	0,18	0,22	-0,036
XEU Benchmark 15Y	-0,18	-0,13	-0,051
XEU Benchmark 20Y	-0,24	-0,17	-0,071
TEC 30	0,70	0,76	-0,060



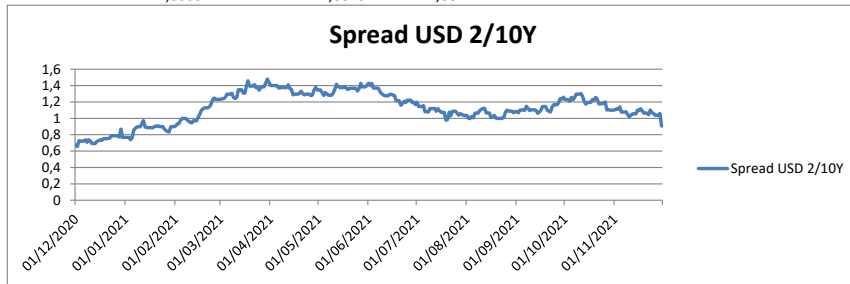
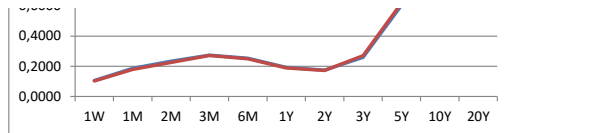
EURIBOR3M	01/12/2021	30/11/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,57					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I DEC21	100,575	100,575	-0,575		101,150	-0,575
I MAR22	100,53	100,53	-0,530		101,060	-0,530
I JUN22	100,48	100,49	-0,480		100,960	-0,490
I SEP22	100,43	100,445	-0,430		100,860	-0,445
I DEC22	100,365	100,38	-0,365		100,730	-0,380
I MAR23	100,265	100,28	-0,265		100,530	-0,280
I JUN23	100,195	100,215	-0,195		100,390	-0,215
I SEP23	100,135	100,16	-0,135		100,270	-0,160
I DEC23	100,08	100,1	-0,080		100,160	-0,100
I MAR24	100,035	100,06	-0,035		100,070	-0,060
I JUN24	100,005	100,03	-0,005		100,010	-0,030
I SEP24	99,98	100,005	0,020		99,960	-0,005



TAUX US EMPRUNTEUR	29/11/2021	26/11/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0778	0,0761	0,076
LIBOR USD 1M	0,0993	0,0904	0,090
LIBOR 2M USD	0,1369	0,1410	0,141
LIBOR 3M USD	0,1709	0,1754	0,175
LIBOR 6M USD	0,2460	0,2460	0,246
30/11/2021			
		29/11/2021	



USA Benchmark 1Y	0,3017	0,3017	0,302
US Benchmark 2Y	0,5491	0,4278	0,428
US Benchmark 3Y	0,7063	0,7575	0,758
US Benchmark 5Y	1,0724	1,1716	1,172
US Benchmark 10Y	1,4551	1,4863	1,486
US Benchmark 20Y	1,8878	1,9361	1,936
US Benchmark 30Y	1,8339	1,8875	1,887



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	29/11/2021	26/11/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0388	0,0378	0,03775
Libor 1 Week/GBP	0,0381	0,0380	0,038
LIBOR 1 Month/GBP	0,0639	0,0623	0,06225
LIBOR 2 Months/GBP	0,0758	0,0720	0,072
LIBOR 3 Months/GBP	0,1029	0,1024	0,10238
LIBOR 6 Months/GBP	0,2791	0,2733	0,27325
	30/11/2021	29/11/2021	
UK Benchmark 1Y	0,1788	0,2115	0,211487
UK Benchmark 2Y	0,4661	0,4661	0,46608
UK Benchmark 3Y	0,5661	0,5434	0,543426
UK Benchmark 4Y	0,4884	0,5028	0,502812
UK Benchmark 5Y	0,6048	0,5860	0,586028
UK Benchmark 6Y	0,5669	0,6042	0,604178
UK Benchmark 7Y	0,7139	0,6558	0,655805
UK Benchmark 8Y	0,7063	0,7207	0,720665
UK Benchmark 9Y	0,7678	0,7926	0,792589
UK Benchmark 10Y	0,8158	0,8645	0,864548
UK Benchmark 12Y	0,8643	0,8769	0,876862
UK Benchmark 15Y	0,9686	0,9918	0,991787
UK Benchmark 20Y	1,0293	1,0753	1,0753

