

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,46%	1,45%	1,45	0,008
DE Benchmark 10Y	-0,36%	-0,37%	0,36	0,000
FR Benchmark 10Y	-0,01%	-0,02%	0,01	0,0023
FR Benchmark 5Y	-0,39%	-0,40%	0,38	-0,005
UK Benchmark 10Y	0,66%	0,65%	0,65	0,007
TEC 10	-0,03			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	71,58	70,87
Petrole Brut Baril	74,58	73,88
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,2374	2,2204
Gaz naturel	3,922	3,802
Or 1 Oc	1785,39	1776,875

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1307	1,1304
EUR/JPY	129,012	129,006
EUR/GBP	0,8515	0,85145
EUR/CAD	1,4482	1,4477
EUR/CNY	7,2018	7,1936
EUR/BRL	6,4252	6,4192

Pnt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	13,4	13,9	5,16	6,02
3 mois	27,51	28,01	17,38	18,24
6 mois	53,5	54,5	41,61	43,34

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,67	-0,37
Deposits EUR 1M	-0,9	-0,6
Deposits EUR 2M	-0,79	-0,49
Deposits EUR 3M	-0,76	-0,46
Deposits EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 12M	-0,66	-0,36

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,494	13/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,577	15/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,574	14/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,625	14/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,605	14/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,545	14/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,508	14/12/2021

	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 TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC21		
I MAR22	100,53	100,535
I JUN22	100,48	100,485
I SEP22	100,41	100,415
I DEC22	100,35	100,355

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,612	-0,571
OIS EUR 3M	-0,602	-0,561
OIS EUR 6M	-0,593	-0,552
OIS EUR 1Y	-0,569	-0,528
OIS EUR 2Y	-0,472	-0,431
OIS EUR 3Y	-0,383	-0,342

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4		
FRA EUR 2x5	-0,555	-0,535
FRA EUR 3x6	-0,54	-0,52
FRA EUR 6x9	-0,49	-0,47
FRA EUR 9x12	-0,428	-0,408
FRA EUR 3x9	-0,49	-0,47
FRA EUR 6x12	-0,432	-0,412
FRA EUR 9x15	-0,367	-0,347
FRA EUR 12x24	-0,189	-0,169

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

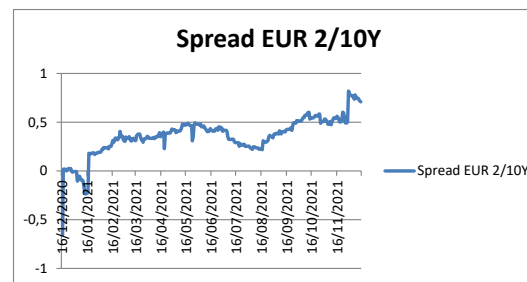
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5335	-0,4935

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

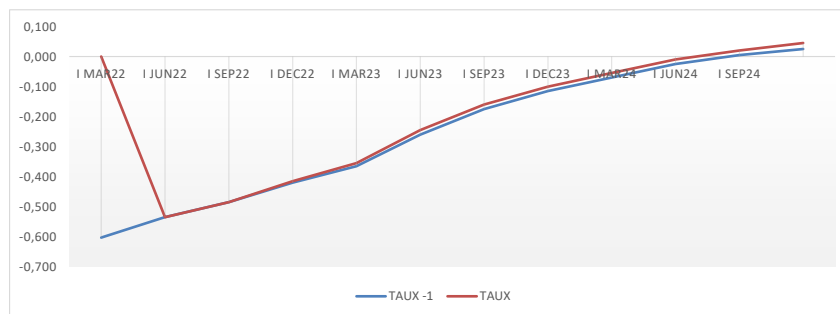
IRS EUR 2Y	-0,3873	-0,3473
IRS EUR 3Y	-0,2818	-0,2418
IRS EUR 4Y	-0,2166	-0,1766
IRS EUR 5Y	-0,1654	-0,1254
IRS EUR 6Y	-0,1202	-0,0802
IRS EUR 7Y	-0,0739	-0,0339
IRS EUR 10Y	0,0707	0,1107



TAUX EURIBOR	14/12/2021	13/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,000
EURIBOR 1M EUR	-0,63	-0,59	-0,032
EURIBOR 3M EUR	-0,61	-0,60	-0,002
EURIBOR 6M EUR	-0,55	-0,55	0,002
EURIBOR 12M EUR	-0,51	-0,50	-0,004
XEU Benchmark 2Y	15/12/2021	14/12/2021	Δ
XEU Benchmark 2Y	-0,72	-0,73	0,010
XEU Benchmark 3Y	-0,70	-0,71	0,006
XEU Benchmark 4Y	-0,70	-0,70	0,007
XEU Benchmark 5Y	-0,44	-0,44	-0,005
XEU Benchmark 6Y	-0,55	-0,56	0,005
XEU Benchmark 7Y	-0,52	-0,53	0,005
XEU Benchmark 8Y	-0,20	-0,20	-0,001
XEU Benchmark 9Y	-0,10	-0,10	0,000
XEU Benchmark 10Y	-0,01	-0,01	0,003
XEU Benchmark 12Y	0,15	0,14	0,002
XEU Benchmark 15Y	-0,18	-0,19	0,009
XEU Benchmark 20Y	-0,23	-0,24	0,012
TEC 30	0,61	0,60	0,010



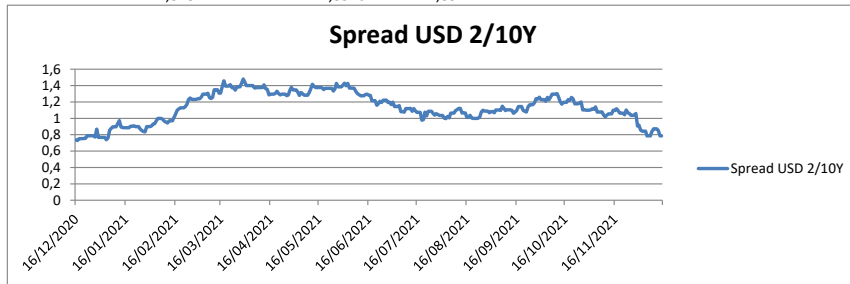
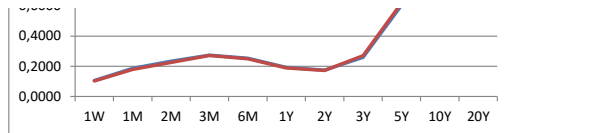
EURIBOR3M	13/12/2021	13/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,605					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I DEC21		100,603	#VALEUR!		#VALEUR!	-0,603
I MAR22	100,535	100,535	-0,535		101,070	-0,535
I JUN22	100,485	100,485	-0,485		100,970	-0,485
I SEP22	100,415	100,42	-0,415		100,830	-0,420
I DEC22	100,355	100,365	-0,355		100,710	-0,365
I MAR23	100,245	100,26	-0,245		100,490	-0,260
I JUN23	100,16	100,175	-0,160		100,320	-0,175
I SEP23	100,1	100,115	-0,100		100,200	-0,115
I DEC23	100,055	100,07	-0,055		100,110	-0,070
I MAR24	100,01	100,025	-0,010		100,020	-0,025
I JUN24	99,98	99,995	0,020		99,960	0,005
I SEP24	99,955	99,975	0,045		99,910	0,025



TAUX US EMPRUNTEUR	14/12/2021	13/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0774	0,0771	0,077
LIBOR USD 1M	0,1075	0,1098	0,110
LIBOR 2M USD	0,1496	0,1504	0,150
LIBOR 3M USD	0,2109	0,2028	0,203
LIBOR 6M USD	0,2911	0,2951	0,295
	15/12/2021	14/12/2021	



USA Benchmark 1Y	0,3111	0,3126	0,313
US Benchmark 2Y	0,6868	0,6798	0,680
US Benchmark 3Y	0,9835	0,9711	0,971
US Benchmark 5Y	1,2980	1,2854	1,285
US Benchmark 10Y	1,4728	1,4674	1,467
US Benchmark 20Y	1,8843	1,8812	1,881
US Benchmark 30Y	1,8484	1,8540	1,854



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	14/12/2021	13/12/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0389	0,0386	0,03863
Libor 1 Week/GBP	0,0564	0,0511	0,05113
LIBOR 1 Month/GBP	0,0646	0,0618	0,06175
LIBOR 2 Months/GBP	0,0651	0,0616	0,06163
LIBOR 3 Months/GBP	0,0915	0,0946	0,09463
LIBOR 6 Months/GBP	0,2690	0,2660	0,266
	15/12/2021	14/12/2021	
UK Benchmark 1Y	0,4225	0,2973	0,297344
UK Benchmark 2Y	0,5032	0,4553	0,455257
UK Benchmark 3Y	0,5466	0,5100	0,509959
UK Benchmark 4Y	0,4927	0,4628	0,46281
UK Benchmark 5Y	0,5831	0,5703	0,570321
UK Benchmark 6Y	0,5470	0,5317	0,531703
UK Benchmark 7Y	0,6281	0,6208	0,620829
UK Benchmark 8Y	0,6024	0,6014	0,601394
UK Benchmark 9Y	0,6675	0,6591	0,659135
UK Benchmark 10Y	0,7560	0,7150	0,714995
UK Benchmark 12Y	0,7827	0,7529	0,752923
UK Benchmark 15Y	0,8945	0,8917	0,891748
UK Benchmark 20Y	0,9811	0,9784	0,978396

