

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,42%	1,41%	1,42	-0,004
DE Benchmark 10Y	-0,35%	-0,36%	0,36	0,017
FR Benchmark 10Y	0,01%	0,00%	0,01	0,0182
FR Benchmark 5Y	-0,38%	-0,39%	0,39	0,015
UK Benchmark 10Y	0,68%	0,67%	0,66	0,021
TEC 10	-0,01			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	71,82	72,38
Petrole Brut Baril	74,54	75,02
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,2499	2,2663
Gaz naturel	3,727	3,766
Or 1 Oc	1808,805	1799,275

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1323	1,1319
EUR/JPY	128,68	128,63
EUR/GBP	0,85028	0,85011
EUR/CAD	1,448	1,4474
EUR/CNY	7,2192	7,211
EUR/BRL	6,4428	6,4365

Pnt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	13,13	13,63	6,01	6,61
3 mois	27,1	27,6	19,14	19,77
6 mois	53,5	54,5	44,94	46,33

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,67	-0,37
Deposits EUR 1M	-0,91	-0,61
Deposits EUR 2M	-0,78	-0,48
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 12M	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,492	14/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,577	16/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,581	15/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,598	15/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,602	15/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,547	15/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,508	15/12/2021

	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	100,535	100,54
I JUN22	100,505	100,51
I SEP22	100,435	100,44
I DEC22	100,37	100,375

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,61	-0,569
OIS EUR 3M	-0,6	-0,559
OIS EUR 6M	-0,596	-0,555
OIS EUR 1Y	-0,58	-0,539
OIS EUR 2Y	-0,491	-0,45
OIS EUR 3Y	-0,407	-0,366

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,576	-0,556
FRA EUR 2x5	-0,557	-0,537
FRA EUR 3x6	-0,547	-0,527
FRA EUR 6x9	-0,512	-0,492
FRA EUR 9x12	-0,451	-0,431
FRA EUR 3x9	-0,505	-0,485
FRA EUR 6x12	-0,454	-0,434
FRA EUR 9x15	-0,388	-0,368
FRA EUR 12x24	-0,211	-0,191

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

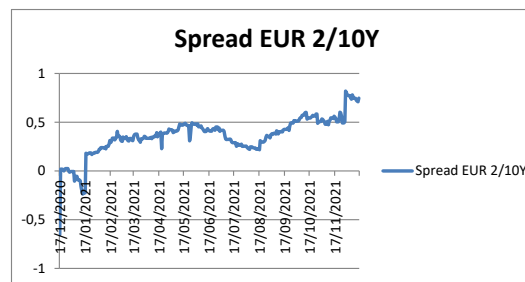
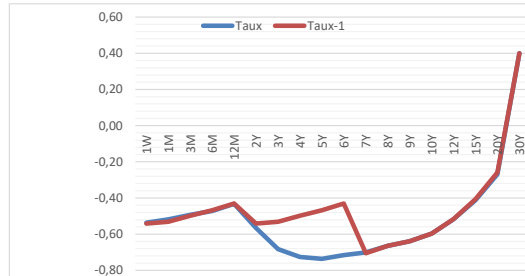
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5432	-0,5032

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

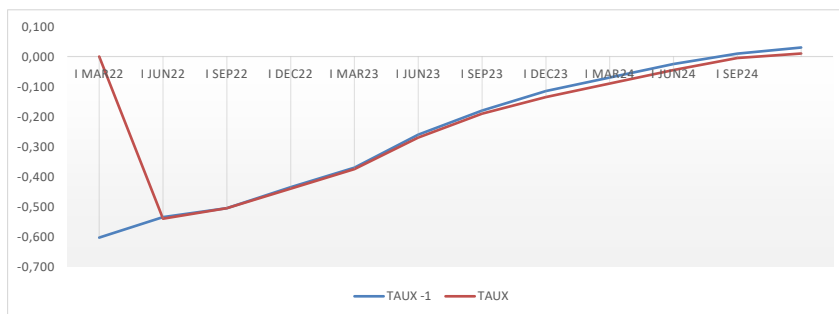
IRS EUR 2Y	-0,4037	-0,3637
IRS EUR 3Y	-0,2974	-0,2574
IRS EUR 4Y	-0,2338	-0,1938
IRS EUR 5Y	-0,1836	-0,1436
IRS EUR 6Y	-0,137	-0,097
IRS EUR 7Y	-0,0893	-0,0493
IRS EUR 10Y	0,0592	0,0992



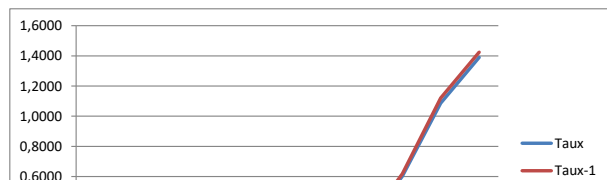
TAUX EURIBOR	15/12/2021	14/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,60	-0,63	0,027
EURIBOR 3M EUR	-0,60	-0,61	0,003
EURIBOR 6M EUR	-0,55	-0,55	-0,002
EURIBOR 12M EUR	-0,51	-0,51	0,000
XEU Benchmark 2Y	16/12/2021	15/12/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,74	-0,72	-0,017
XEU Benchmark 3Y	-0,72	-0,70	-0,011
XEU Benchmark 4Y	-0,71	-0,70	-0,011
XEU Benchmark 5Y	-0,43	-0,44	0,007
XEU Benchmark 6Y	-0,56	-0,55	-0,008
XEU Benchmark 7Y	-0,53	-0,52	-0,006
XEU Benchmark 8Y	-0,18	-0,20	0,019
XEU Benchmark 9Y	-0,08	-0,10	0,020
XEU Benchmark 10Y	0,01	-0,01	0,021
XEU Benchmark 12Y	0,17	0,15	0,027
XEU Benchmark 15Y	-0,16	-0,18	0,018
XEU Benchmark 20Y	-0,21	-0,23	0,024
TEC 30	0,65	0,61	0,040



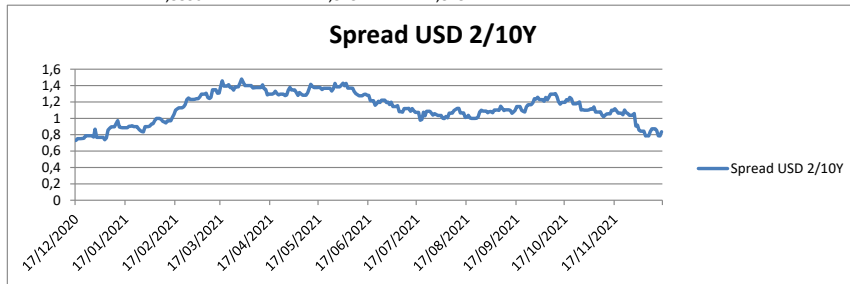
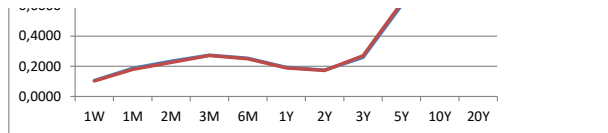
EURIBOR3M	13/12/2021	13/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,602					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I DEC21		100,603	#VALEUR!		#VALEUR!	-0,603 #VALEUR!
I MAR22	100,54	100,535	-0,540		101,080	-0,535 0,062
I JUN22	100,505	100,505	-0,505		101,010	-0,505 0,097
I SEP22	100,44	100,435	-0,440		100,880	-0,435 0,162
I DEC22	100,375	100,37	-0,375		100,750	-0,370 0,227
I MAR23	100,27	100,26	-0,270		100,540	-0,260 0,332
I JUN23	100,19	100,18	-0,190		100,380	-0,180 0,412
I SEP23	100,135	100,115	-0,135		100,270	-0,115 0,467
I DEC23	100,09	100,07	-0,090		100,180	-0,070 0,512
I MAR24	100,045	100,025	-0,045		100,090	-0,025 0,557
I JUN24	100,005	99,99	-0,005		100,010	0,010 0,597
I SEP24	99,99	99,97	0,010		99,980	0,030 0,612



TAUX US EMPRUNTEUR	15/12/2021	14/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0785	0,0774	0,077
LIBOR USD 1M	0,1086	0,1075	0,108
LIBOR 2M USD	0,1579	0,1496	0,150
LIBOR 3M USD	0,2156	0,2109	0,211
LIBOR 6M USD	0,3015	0,2911	0,291
	16/12/2021	15/12/2021	



USA Benchmark 1Y	0,3053	0,3111	0,311
US Benchmark 2Y	0,6437	0,6868	0,687
US Benchmark 3Y	0,9155	0,9835	0,984
US Benchmark 5Y	1,2771	1,2980	1,298
US Benchmark 10Y	1,4794	1,4728	1,473
US Benchmark 20Y	1,9266	1,8843	1,884
US Benchmark 30Y	1,8830	1,8484	1,848



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	15/12/2021	14/12/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,0386	0,0389	0,03888
Libor 1 Week/GBP	0,0754	0,0564	0,05638
LIBOR 1 Month/GBP	0,0948	0,0646	0,06463
LIBOR 2 Months/GBP	0,1035	0,0651	0,06513
LIBOR 3 Months/GBP	0,0984	0,0915	0,0915
LIBOR 6 Months/GBP	0,3141	0,2690	0,269
	16/12/2021	15/12/2021	
UK Benchmark 1Y	0,3786	0,4225	0,42252
UK Benchmark 2Y	0,5418	0,5032	0,503203
UK Benchmark 3Y	0,5829	0,5466	0,546606
UK Benchmark 4Y	0,5276	0,4927	0,492692
UK Benchmark 5Y	0,6285	0,5831	0,583052
UK Benchmark 6Y	0,5810	0,5470	0,547045
UK Benchmark 7Y	0,6657	0,6281	0,628087
UK Benchmark 8Y	0,6504	0,6024	0,602419
UK Benchmark 9Y	0,7043	0,6675	0,667488
UK Benchmark 10Y	0,7351	0,7560	0,755993
UK Benchmark 12Y	0,7929	0,7827	0,78268
UK Benchmark 15Y	0,9233	0,8945	0,894516
UK Benchmark 20Y	1,0212	0,9811	0,981065

