

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,43%	1,42%	1,43	-0,002
DE Benchmark 10Y	-0,37%	-0,37%	0,36	-0,002
FR Benchmark 10Y	0,00%	-0,01%	0,01	0,0011
FR Benchmark 5Y	-0,41%	-0,42%	0,42	0,008
UK Benchmark 10Y	0,70%	0,69%	0,70	0,000
TEC 10	-0,04			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	69,07	70,86
Petrole Brut Baril	71,77	71,52
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,1811	2,173
Gaz naturel	3,744	3,834
Or 1 Oc	1794,0465	1790,72

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1291	1,1288
EUR/JPY	128,32	128,28
EUR/GBP	0,8532	0,85299
EUR/CAD	1,46133	1,46119
EUR/CNY	7,1968	7,1886
EUR/BRL	6,4858	6,4793

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	10,07	10,82	6,03	7,17
3 mois	23,86	24,61	19,21	20,36
6 mois	50,7	52,2	45,59	47,7

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,67	-0,37
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	-0,492	16/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,576	20/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,588	17/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,611	17/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,581	17/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,551	17/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,511	17/12/2021

	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	100,515	100,52
I SEP22	100,46	100,465
I DEC22	100,395	100,4

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,607	-0,566
OIS EUR 3M	-0,6	-0,559
OIS EUR 6M	-0,595	-0,554
OIS EUR 1Y	-0,584	-0,543
OIS EUR 2Y	-0,5	-0,459
OIS EUR 3Y	-0,412	-0,371

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4		
FRA EUR 2x5	-0,559	-0,539
FRA EUR 3x6		
FRA EUR 6x9	-0,527	-0,507
FRA EUR 9x12	-0,474	-0,454
FRA EUR 3x9	-0,514	-0,494
FRA EUR 6x12	-0,473	-0,453
FRA EUR 9x15	-0,409	-0,389
FRA EUR 12x24	-0,226	-0,206

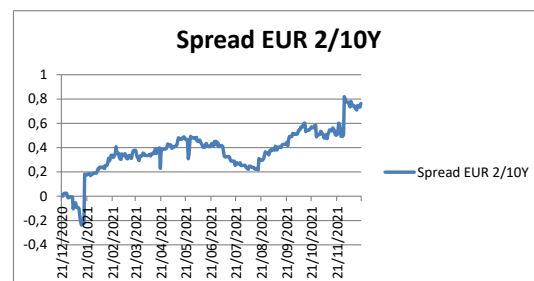
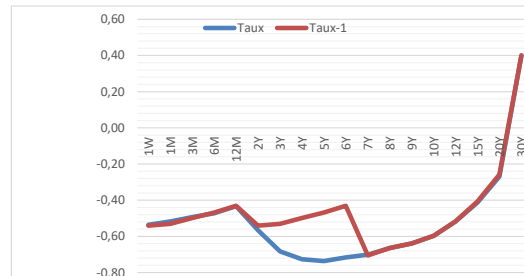
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

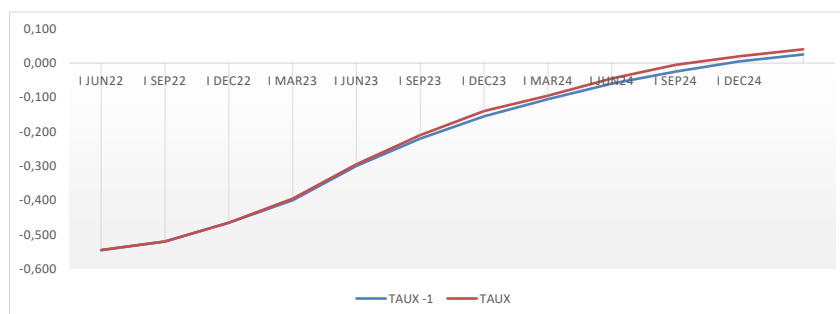
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5537	-0,5137
IRS EUR 2Y	-0,4155	-0,3755
IRS EUR 3Y	-0,3038	-0,2638
IRS EUR 4Y	-0,2365	-0,1965
IRS EUR 5Y	-0,1836	-0,1436
IRS EUR 6Y	-0,1329	-0,0929
IRS EUR 7Y	-0,0805	-0,0405
IRS EUR 10Y	0,0797	0,1197



TAUX EURIBOR	17/12/2021	16/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,59	-0,57	-0,017
EURIBOR 1M EUR	-0,61	-0,59	-0,018
EURIBOR 3M EUR	-0,58	-0,59	0,008
EURIBOR 6M EUR	-0,55	-0,55	-0,003
EURIBOR 12M EUR	-0,51	-0,51	-0,003
	20/12/2021	17/12/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,77	-0,76	-0,014
XEU Benchmark 3Y	-0,75	-0,74	-0,009
XEU Benchmark 4Y	-0,73	-0,73	-0,004
XEU Benchmark 5Y	-0,47	-0,46	-0,002
XEU Benchmark 6Y	-0,58	-0,58	0,004
XEU Benchmark 7Y	-0,54	-0,55	0,006
XEU Benchmark 8Y	-0,20	-0,21	0,008
XEU Benchmark 9Y	-0,10	-0,12	0,011
XEU Benchmark 10Y	-0,01	-0,03	0,015
XEU Benchmark 12Y	0,15	0,14	0,017
XEU Benchmark 15Y	-0,16	-0,18	0,019
XEU Benchmark 20Y	-0,20	-0,23	0,027
TEC 30	0,64	0,67	-0,030

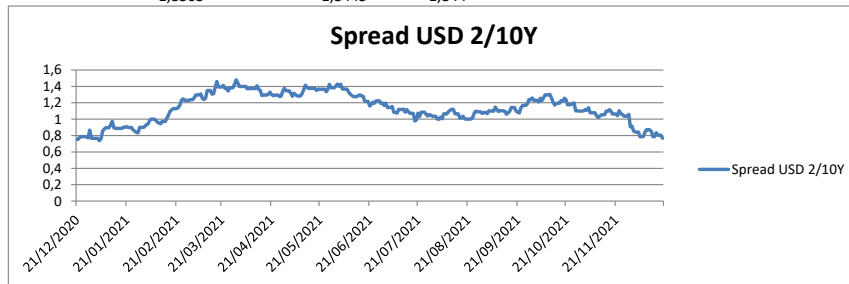
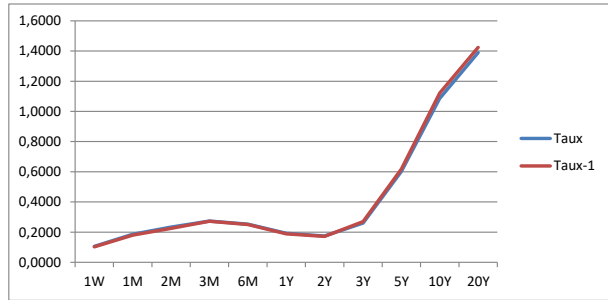


EURIBOR3M	21/12/2021	20/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,581						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I MAR22	100,545	100,545	-0,545		101,090	-0,545	0,036
I JUN22	100,52	100,52	-0,520		101,040	-0,520	0,061
I SEP22	100,465	100,465	-0,465		100,930	-0,465	0,116
I DEC22	100,395	100,4	-0,395		100,790	-0,400	0,186
I MAR23	100,295	100,3	-0,295		100,590	-0,300	0,286
I JUN23	100,21	100,22	-0,210		100,420	-0,220	0,371
I SEP23	100,14	100,155	-0,140		100,280	-0,155	0,441
I DEC23	100,095	100,105	-0,095		100,190	-0,105	0,486
I MAR24	100,045	100,06	-0,045		100,090	-0,060	0,536
I JUN24	100,005	100,025	-0,005		100,010	-0,025	0,576
I SEP24	99,98	99,995	0,020		99,960	0,005	0,601
I DEC24	99,96	99,975	0,040		99,920	0,025	0,621



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	17/12/2021	16/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0764	0,0751	0,075
LIBOR USD 1M	0,1025	0,1039	0,104
LIBOR 2M USD	0,1484	0,1539	0,154
LIBOR 3M USD	0,2126	0,2136	0,214
LIBOR 6M USD	0,3128	0,3115	0,312
	<b>20/12/2021</b>	<b>17/12/2021</b>	
USA Benchmark 1Y	0,2947	0,2995	0,300
US Benchmark 2Y	0,6315	0,6507	0,651
US Benchmark 3Y	0,8776	0,9034	0,903
US Benchmark 5Y	1,1831	1,2437	1,244
US Benchmark 10Y	1,3977	1,4543	1,454
US Benchmark 20Y	1,8696	1,8825	1,882
US Benchmark 30Y	1,8363	1,8445	1,844



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	17/12/2021	16/12/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,1748	0,0384	0,03838
Libor 1 Week/GBP	0,1859	0,0614	0,06138
LIBOR 1 Month/GBP	0,1791	0,0758	0,07575
LIBOR 2 Months/GBP	0,1838	0,0889	0,08888
LIBOR 3 Months/GBP	0,2218	0,1004	0,10038
LIBOR 6 Months/GBP	0,3944	0,3270	0,327
	<b>20/12/2021</b>	<b>17/12/2021</b>	
UK Benchmark 1Y	0,2009	0,3881	0,388145
UK Benchmark 2Y	0,5631	0,5280	0,528026
UK Benchmark 3Y	0,5966	0,5832	0,583208
UK Benchmark 4Y	0,5386	0,5254	0,5254
UK Benchmark 5Y	0,6481	0,6318	0,631807
UK Benchmark 6Y	0,5886	0,5795	0,579507
UK Benchmark 7Y	0,6805	0,6701	0,670141
UK Benchmark 8Y	0,6594	0,6530	0,652974
UK Benchmark 9Y	0,7070	0,7008	0,700813
UK Benchmark 10Y	0,7756	0,7585	0,758491
UK Benchmark 12Y	0,7948	0,8065	0,806548
UK Benchmark 15Y	0,9394	0,9344	0,934365
UK Benchmark 20Y	1,0293	1,0326	1,032644

