

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,48%	1,48%	1,47	0,005
DE Benchmark 10Y	-0,25%	-0,26%	0,25	0,000
FR Benchmark 10Y	0,12%	0,12%	0,12	0
FR Benchmark 5Y	-0,32%	-0,33%	0,32	0,000
UK Benchmark 10Y	0,85%	0,84%	0,85	0,000
TEC 10	0,1			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	75,55	75,57
Petrole Brut Baril	78,49	78,6
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,3644	2,3535
Gaz naturel	4,038	4,06
Or 1 Oc	1813,897	1812,1

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1318	1,1314
EUR/JPY	129,975	129,968
EUR/GBP	0,84264	0,84247
EUR/CAD	1,4504	1,4464
EUR/CNY	7,2148	7,2065
EUR/BRL	6,3696	6,3626

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	8,77	9,82	4,98	6,52
3 mois	22,76	23,81	18,63	20,16
6 mois	51,32	52,82	45,97	48,35

## MARCHÉ MONÉTAIRE

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

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,491	23/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,576	27/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,579	24/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,621	24/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,587	24/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,544	24/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,494	24/12/2021

	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	100,32	100,325

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,608	-0,567
OIS EUR 3M	-0,6	-0,559
OIS EUR 6M	-0,595	-0,554
OIS EUR 1Y	-0,564	-0,523
OIS EUR 2Y	-0,44	-0,399
OIS EUR 3Y	-0,327	-0,286

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4		
FRA EUR 2x5		
FRA EUR 3x6		
FRA EUR 6x9		
FRA EUR 9x12		
FRA EUR 3x9		
FRA EUR 6x12		
FRA EUR 9x15		
FRA EUR 12x24		

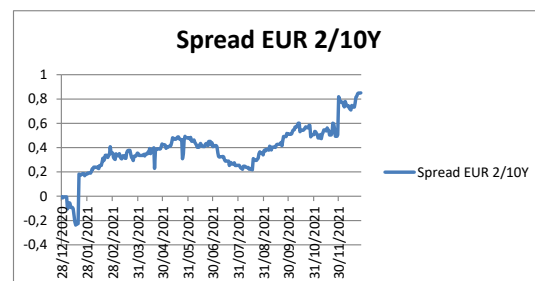
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

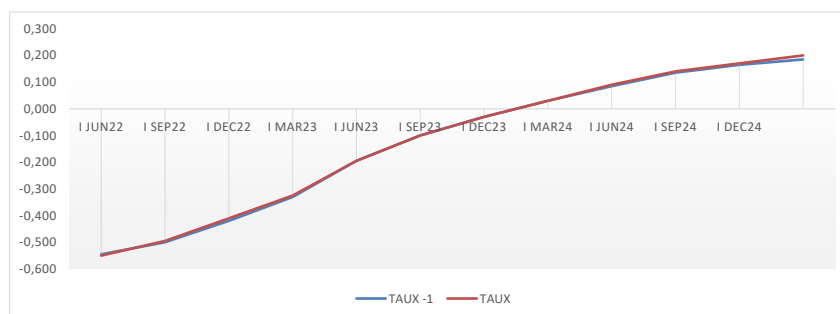
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5354	-0,4954
IRS EUR 2Y	-0,3665	-0,3265
IRS EUR 3Y	-0,2428	-0,2028
IRS EUR 4Y	-0,1642	-0,1242
IRS EUR 5Y	-0,0934	-0,0534
IRS EUR 6Y	-0,0388	0,0012
IRS EUR 7Y	0,0164	0,0564
IRS EUR 10Y	0,1891	0,2291



TAUX EURIBOR	24/12/2021	23/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,58	-0,001
EURIBOR 1M EUR	-0,62	-0,65	0,027
EURIBOR 3M EUR	-0,59	-0,59	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,54	-0,007
EURIBOR 12M EUR	-0,49	-0,50	0,005
	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	-0,35	-0,37	0,016
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	0,05	0,02	0,026
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	-0,07	-0,016
TEC 30	0,81	0,81	0,000

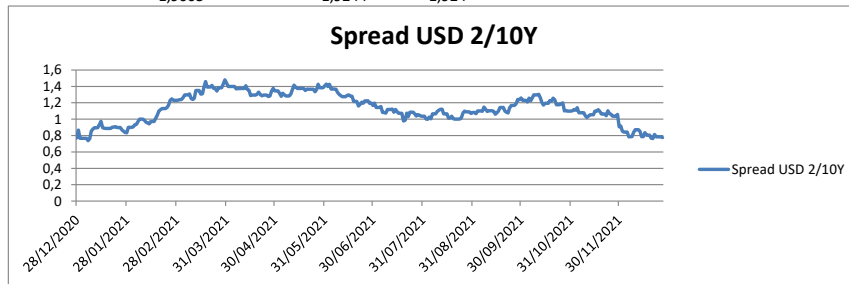
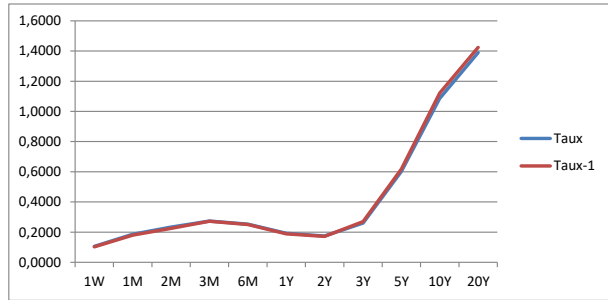


EURIBOR3M	28/12/2021	27/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,587					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,55	100,545	-0,550		101,100	-0,545
I JUN22	100,495	100,5	-0,495		100,990	-0,500
I SEP22	100,41	100,42	-0,410		100,820	-0,420
I DEC22	100,325	100,33	-0,325		100,650	-0,330
I MAR23	100,195	100,195	-0,195		100,390	-0,195
I JUN23	100,1	100,1	-0,100		100,200	-0,100
I SEP23	100,03	100,03	-0,030		100,060	-0,030
I DEC23	99,97	99,97	0,030		99,940	0,030
I MAR24	99,91	99,915	0,090		99,820	0,085
I JUN24	99,86	99,865	0,140		99,720	0,135
I SEP24	99,83	99,835	0,170		99,660	0,165
I DEC24	99,8	99,815	0,200		99,600	0,185



**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
	<b>27/12/2021</b>	<b>23/12/2021</b>	
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
	<b>27/12/2021</b>	<b>23/12/2021</b>	
UK Benchmark 1Y	0,5603	0,5650	0,565045
UK Benchmark 2Y	0,6446	0,6998	0,699795
UK Benchmark 3Y	0,7281	0,7572	0,757185
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	0,8197	0,81966
UK Benchmark 9Y	0,8527	0,8762	0,876234
UK Benchmark 10Y	0,9144	0,9351	0,935081
UK Benchmark 12Y	0,9769	0,9498	0,949841
UK Benchmark 15Y	1,0657	1,0892	1,089157
UK Benchmark 20Y	1,1620	1,1885	1,188466

