

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,50%	1,50%	1,50	0,000
DE Benchmark 10Y	-0,18%	-0,19%	0,18	0,000
FR Benchmark 10Y	0,20%	0,20%	0,21	-0,0047
FR Benchmark 5Y	-0,25%	-0,26%	0,25	0,000
UK Benchmark 10Y	0,90%	0,90%	0,90	0,000
TEC 10	0,1			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	75,84	75,21
Petrole Brut Baril	78,45	77,78
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,3472	2,3253
Gaz naturel	3,71	3,73
Or 1 Oc	1823,235	1821,9

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1338	1,1334
EUR/JPY	130,741	130,735
EUR/GBP	0,83972	0,83967
EUR/CAD	1,43777	1,43762
EUR/CNY	7,2096	7,2013
EUR/BRL	6,3338	6,2985

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,1	7,55	5,67	6,38
3 mois	21,45	22,05	19,02	20,09
6 mois	49,14	50,64	45,61	47,98

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-1,36	-1,06
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	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,495	30/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,59	31/12/2021
EURIBOR 1W EUR	-0,574	31/12/2021
EURIBOR 1M EUR	-0,583	31/12/2021
EURIBOR 3M EUR	-0,572	31/12/2021
EURIBOR 6M EUR	-0,546	31/12/2021
EURIBOR 12M EUR	-0,501	31/12/2021

	31/12/2021	30/11/2021
TMO	0,27	0,35
TME	0,07	0,15
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	100,5	100,505
I SEP22	100,4	100,41
I DEC22	100,3	100,305

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,593	-0,552
OIS EUR 6M	-0,588	-0,547
OIS EUR 1Y	-0,558	-0,517
OIS EUR 2Y	-0,42	-0,379
OIS EUR 3Y	-0,299	-0,258

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,567	-0,547
FRA EUR 2x5	-0,554	-0,534
FRA EUR 3x6	-0,546	-0,526
FRA EUR 6x9	-0,496	-0,476
FRA EUR 9x12	-0,404	-0,384
FRA EUR 3x9	-0,498	-0,478
FRA EUR 6x12	-0,424	-0,404
FRA EUR 9x15	-0,321	-0,301
FRA EUR 12x24	-0,082	-0,062

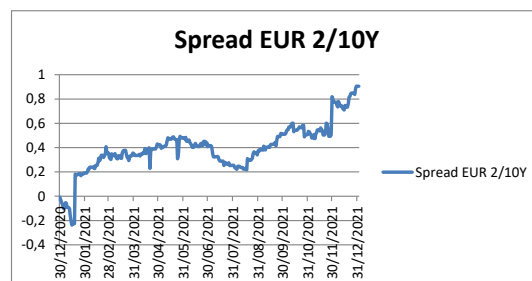
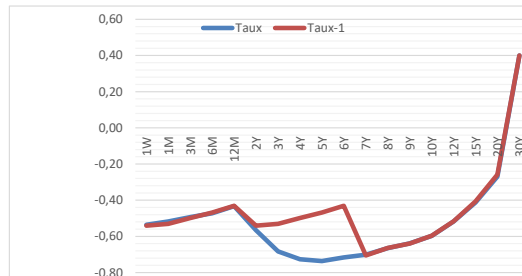
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

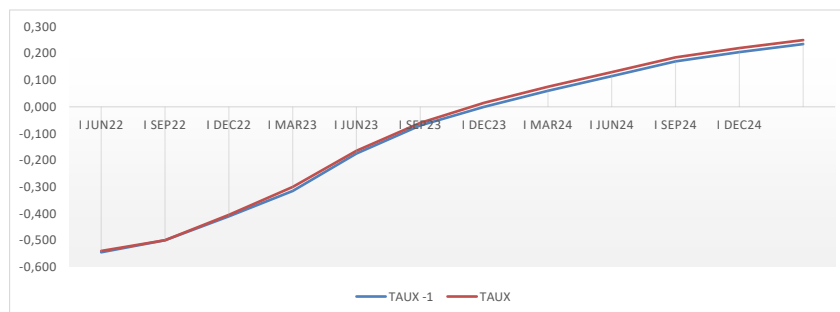
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5227	-0,4827
IRS EUR 2Y	-0,3278	-0,2878
IRS EUR 3Y	-0,1841	-0,1441
IRS EUR 4Y	-0,0896	-0,0496
IRS EUR 5Y	-0,0209	0,0191
IRS EUR 6Y	0,0342	0,0742
IRS EUR 7Y	0,0899	0,1299
IRS EUR 10Y	0,264	0,304



TAUX EURIBOR	31/12/2021	30/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,59	0,013
EURIBOR 1M EUR	-0,58	-0,59	0,002
EURIBOR 3M EUR	-0,57	-0,57	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,55	-0,55	0,000
EURIBOR 12M EUR	-0,50	-0,50	-0,003
	30/12/2021	29/12/2021	
XEU Benchmark 2Y	-0,70	-0,69	-0,012
XEU Benchmark 3Y	-0,66	-0,65	-0,004
XEU Benchmark 4Y	-0,61	-0,60	-0,003
XEU Benchmark 5Y	-0,31	-0,31	0,000
XEU Benchmark 6Y	-0,42	-0,42	0,000
XEU Benchmark 7Y	-0,38	-0,38	0,000
XEU Benchmark 8Y	-0,01	-0,01	0,005
XEU Benchmark 9Y	0,11	0,11	0,000
XEU Benchmark 10Y	0,20	0,19	0,006
XEU Benchmark 12Y	0,37	0,37	0,005
XEU Benchmark 15Y	0,03	0,02	0,007
XEU Benchmark 20Y	-0,02	-0,01	-0,008
TEC 30	0,81	0,81	0,000

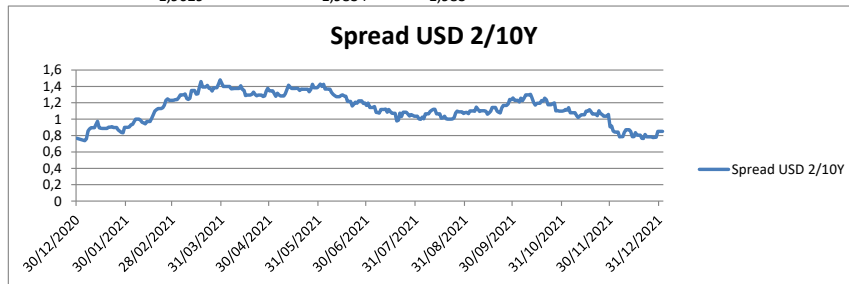
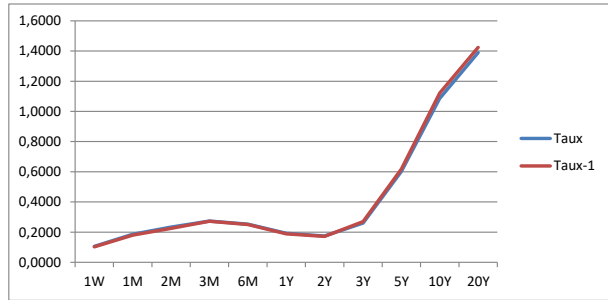



EURIBOR3M	03/01/2022	31/12/2021	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,572					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,54	100,545	-0,540		101,080	-0,545
I JUN22	100,5	100,5	-0,500		101,000	-0,500
I SEP22	100,405	100,41	-0,405		100,810	-0,410
I DEC22	100,3	100,315	-0,300		100,600	-0,315
I MAR23	100,165	100,175	-0,165		100,330	-0,175
I JUN23	100,06	100,07	-0,060		100,120	-0,070
I SEP23	99,985	100	0,015		99,970	0,000
I DEC23	99,925	99,94	0,075		99,850	0,060
I MAR24	99,87	99,885	0,130		99,740	0,115
I JUN24	99,815	99,83	0,185		99,630	0,170
I SEP24	99,78	99,795	0,220		99,560	0,205
I DEC24	99,75	99,765	0,250		99,500	0,235



TAUX US EMPRUNTEUR 

	30/12/2021	29/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0763	0,0765	0,077
LIBOR USD 1M	0,1019	0,1043	0,104
LIBOR 2M USD	0,1545	0,1583	0,158
LIBOR 3M USD	0,2144	0,2238	0,224
LIBOR 6M USD	0,3451	0,3544	0,354
	30/12/2021	29/12/2021	
USA Benchmark 1Y	0,3621	0,3636	0,364
US Benchmark 2Y	0,7181	0,7365	0,736
US Benchmark 3Y	0,9815	1,0008	1,001
US Benchmark 5Y	1,3300	1,3047	1,305
US Benchmark 10Y	1,5691	1,5161	1,516
US Benchmark 20Y	1,9935	2,0068	2,007
US Benchmark 30Y	1,9629	1,9834	1,983



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	30/12/2021	29/12/2021	Δ
LIBOR ON/GBP	0,1858	0,1864	0,18638
Libor 1 Week/GBP	0,1839	0,1863	0,18625
LIBOR 1 Month/GBP	0,1843	0,1839	0,18388
LIBOR 2 Months/GBP	0,2271	0,2286	0,22863
LIBOR 3 Months/GBP	0,2515	0,2488	0,24875
LIBOR 6 Months/GBP	0,4893	0,4801	0,48013
	30/12/2021	29/12/2021	
UK Benchmark 1Y	0,6099	0,6458	0,645766
UK Benchmark 2Y	0,6905	0,6897	0,689726
UK Benchmark 3Y	0,7764	0,7759	0,77592
UK Benchmark 4Y	0,7274	0,7245	0,724493
UK Benchmark 5Y	0,8326	0,8496	0,849561
UK Benchmark 6Y	0,8048	0,7959	0,795884
UK Benchmark 7Y	0,8927	0,9029	0,902916
UK Benchmark 8Y	0,8738	0,9032	0,903213
UK Benchmark 9Y	0,9295	0,9414	0,941443
UK Benchmark 10Y	0,9886	0,9759	0,975904
UK Benchmark 12Y	1,0765	1,0571	1,05709
UK Benchmark 15Y	1,1289	1,1685	1,168537
UK Benchmark 20Y	1,2360	1,2485	1,248548

