

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,65%	1,65%	1,65	0,000
DE Benchmark 10Y	-0,12%	-0,13%	0,12	-0,001
FR Benchmark 10Y	0,23%	0,22%	0,24	-0,0113
FR Benchmark 5Y	-0,23%	-0,24%	0,23	-0,003
UK Benchmark 10Y	1,01%	1,01%	1,01	0,000
TEC 10	0,22			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	77,05	76,99
Petrole Brut Baril	80,1	80
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,4136	2,4095
Gaz naturel	3,767	3,717
Or 1 Oc	1814,14	1814,5

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,13	1,1297
EUR/JPY	131,069	131,062
EUR/GBP	0,8341	0,83405
EUR/CAD	1,43678	1,43665
EUR/CNY	7,1834	7,1751
EUR/BRL	6,4176	6,4106

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,42	6,57	5,4	5,61
3 mois	20,73	20,97	19,19	19,53
6 mois	48,53	49,13	46,13	47,04

MARCHÉ MONETAIRE

MARCHÉ MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,67	-0,37
Deposît EUR 1M	-0,67	-0,37
Deposît EUR 2M	-0,76	-0,46
Deposît EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposît EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 12M	-0,65	-0,35

FIXING	TAUX	DATE
EONIA	-0,505	31/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,578	04/01/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,587	03/01/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,576	03/01/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,57	03/01/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,539	03/01/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,499	03/01/2022

	31/12/2021	30/11/2021
TMO	0,27	0,35
TME	0,07	0,15
TMM	-0,4924	-0,4879
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,596	-0,565
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,581	-0,567

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I MAR22	100,545	100,55
I JUN22	100,5	100,505
I SEP22	100,415	100,42
I DEC22	100,32	100,325

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,594	-0,553
OIS EUR 6M	-0,589	-0,548
OIS EUR 1Y	-0,56	-0,519
OIS EUR 2Y	-0,427	-0,386
OIS EUR 3Y	-0,304	-0,263

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,566	-0,546
FRA EUR 2x5	-0,558	-0,538
FRA EUR 3x6	-0,551	-0,531
FRA EUR 6x9	-0,506	-0,486
FRA EUR 9x12	-0,429	-0,409
FRA EUR 3x9	-0,496	-0,476
FRA EUR 6x12	-0,432	-0,412
FRA EUR 9x15	-0,327	-0,307
FRA EUR 12x24	-0,063	-0,043

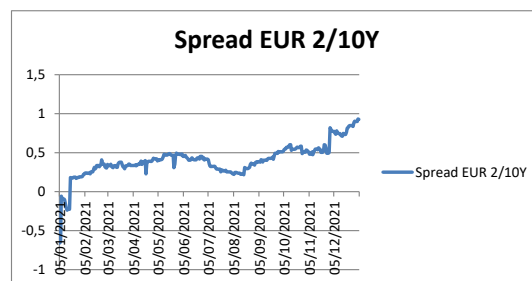
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

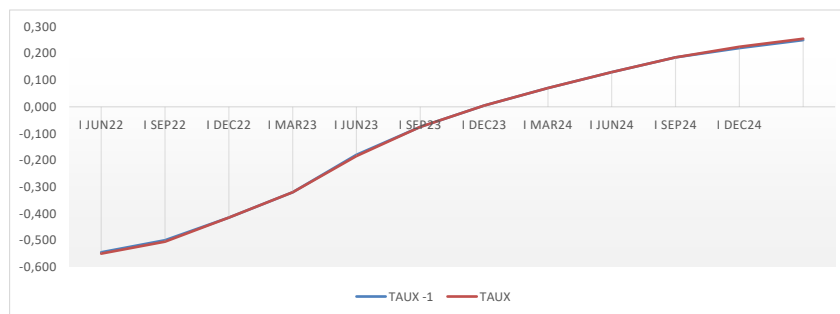
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5238	-0,4838
IRS EUR 2Y	-0,3351	-0,2951
IRS EUR 3Y	-0,1839	-0,1439
IRS EUR 4Y	-0,081	-0,041
IRS EUR 5Y	-0,0105	0,0295
IRS EUR 6Y	0,0463	0,0863
IRS EUR 7Y	0,1039	0,1439
IRS EUR 10Y	0,2873	0,3273



TAUX EURIBOR	03/01/2022	31/12/2021	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,59	-0,57	-0,013
EURIBOR 1M EUR	-0,58	-0,58	0,007
EURIBOR 3M EUR	-0,57	-0,57	0,002
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,55	0,007
EURIBOR 12M EUR	-0,50	-0,50	0,002
	04/01/2022	03/01/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,69	-0,69	-0,007
XEU Benchmark 3Y	-0,60	-0,61	0,010
XEU Benchmark 4Y	-0,57	-0,57	-0,003
XEU Benchmark 5Y	-0,29	-0,28	-0,010
XEU Benchmark 6Y	-0,36	-0,37	0,003
XEU Benchmark 7Y	-0,32	-0,32	0,000
XEU Benchmark 8Y	0,02	0,03	-0,003
XEU Benchmark 9Y	0,14	0,14	-0,001
XEU Benchmark 10Y	0,24	0,25	-0,010
XEU Benchmark 12Y	0,41	0,40	0,001
XEU Benchmark 15Y	0,08	0,08	0,003
XEU Benchmark 20Y	0,05	0,04	0,008
TEC 30	0,93	0,89	0,040

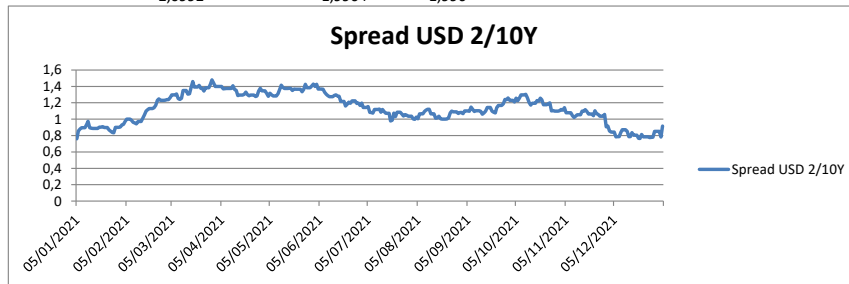
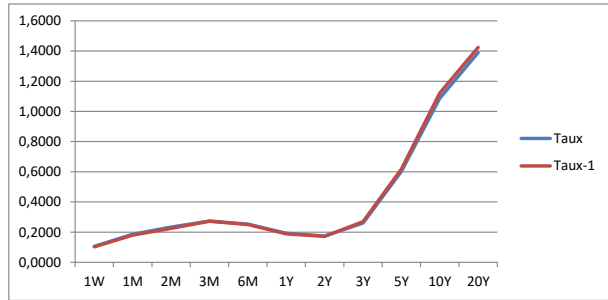


EURIBOR3M	05/01/2022	04/01/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,57					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,55	100,545	-0,550		101,100	-0,545
I JUN22	100,505	100,5	-0,505		101,010	-0,500
I SEP22	100,415	100,415	-0,415		100,830	-0,415
I DEC22	100,32	100,32	-0,320		100,640	-0,320
I MAR23	100,185	100,18	-0,185		100,370	-0,180
I JUN23	100,075	100,075	-0,075		100,150	-0,075
I SEP23	99,995	99,995	0,005		99,990	0,005
I DEC23	99,93	99,93	0,070		99,860	0,070
I MAR24	99,87	99,87	0,130		99,740	0,130
I JUN24	99,815	99,815	0,185		99,630	0,185
I SEP24	99,775	99,78	0,225		99,550	0,220
I DEC24	99,745	99,75	0,255		99,490	0,250



TAUX US EMPRUNTEUR 

	30/12/2021	29/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0763	0,0765	0,077
LIBOR USD 1M	0,1013	0,1019	0,102
LIBOR 2M USD	0,1545	0,1583	0,158
LIBOR 3M USD	0,2091	0,2144	0,214
LIBOR 6M USD	0,3388	0,3451	0,345
	04/01/2022	03/01/2022	
USA Benchmark 1Y	0,3801	0,3838	0,384
US Benchmark 2Y	0,7547	0,7680	0,768
US Benchmark 3Y	1,0218	1,0716	1,072
US Benchmark 5Y	1,4173	1,3154	1,315
US Benchmark 10Y	1,6708	1,5494	1,549
US Benchmark 20Y	2,1269	2,0343	2,034
US Benchmark 30Y	2,0992	1,9964	1,996



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
	04/01/2022	03/01/2022	
UK Benchmark 1Y	0,6068	0,6055	0,605529
UK Benchmark 2Y	0,7776	0,6592	0,659201
UK Benchmark 3Y	0,8450	0,7639	0,763945
UK Benchmark 4Y	0,8132	0,7240	0,723977
UK Benchmark 5Y	0,9160	0,8293	0,829332
UK Benchmark 6Y	0,8861	0,7801	0,78013
UK Benchmark 7Y	0,9798	0,8948	0,894751
UK Benchmark 8Y	0,9650	0,8618	0,861821
UK Benchmark 9Y	1,0171	0,9107	0,910681
UK Benchmark 10Y	1,1007	0,9667	0,966693
UK Benchmark 12Y	1,0955	1,0385	1,038484
UK Benchmark 15Y	1,1965	1,1029	1,102871
UK Benchmark 20Y	1,2829	1,2025	1,202497

