

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,72%	1,72%	1,73	-0,006
DE Benchmark 10Y	-0,10%	-0,11%	0,05	-0,045
FR Benchmark 10Y	0,26%	0,25%	0,28	-0,018
FR Benchmark 5Y	-0,21%	-0,22%	0,20	-0,010
UK Benchmark 10Y	1,09%	1,08%	1,09	0,000
TEC 10	0,26			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	80,01	79,46
Petrole Brut Baril	82,54	81,99
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,4816	2,4777
Gaz naturel	3,86	3,812
Or 1 Oc	1789,71	1791,375

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1307	1,1304
EUR/JPY	131,023	131,017
EUR/GBP	0,83527	0,83522
EUR/CAD	1,43866	1,43853
EUR/CNY	7,2094	7,2011
EUR/BRL	6,4282	6,4227

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,63	6,77	5,57	5,77
3 mois	21,73	21,99	19,55	19,92
6 mois	51,25	51,85	47,05	47,96

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,68	-0,38
Deposits EUR 1M	-0,67	-0,37
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	-0,505	31/12/2021
ECB ESTR Short Term	-0,578	06/01/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,581	05/01/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,566	05/01/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,576	05/01/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,541	05/01/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,5	05/01/2022

	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	100,505	100,51
I SEP22	100,415	100,42
I DEC22	100,315	100,32

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,596	-0,555
OIS EUR 3M	-0,594	-0,553
OIS EUR 6M	-0,59	-0,549
OIS EUR 1Y	-0,561	-0,52
OIS EUR 2Y	-0,412	-0,371
OIS EUR 3Y	-0,283	-0,242

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,57	-0,55
FRA EUR 2x5	-0,559	-0,539
FRA EUR 3x6	-0,547	-0,527
FRA EUR 6x9	-0,499	-0,479
FRA EUR 9x12	-0,411	-0,391
FRA EUR 3x9	-0,496	-0,476
FRA EUR 6x12	-0,427	-0,407
FRA EUR 9x15	-0,322	-0,302
FRA EUR 12x24	-0,041	-0,021

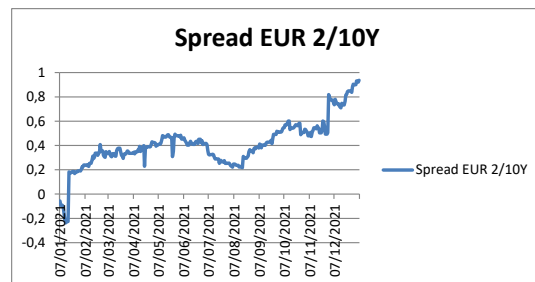
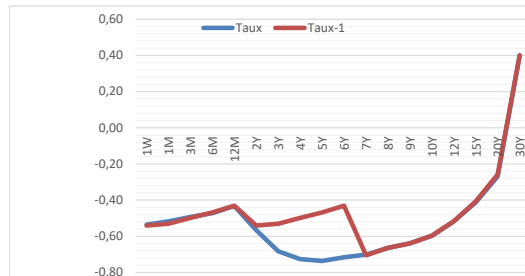
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

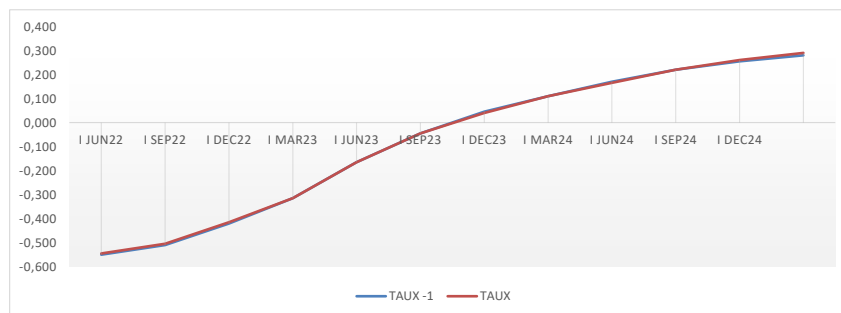
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5273	-0,4873
IRS EUR 2Y	-0,3203	-0,2803
IRS EUR 3Y	-0,1655	-0,1255
IRS EUR 4Y	-0,0647	-0,0247
IRS EUR 5Y	0,01	0,05
IRS EUR 6Y	0,0672	0,1072
IRS EUR 7Y	0,1255	0,1655
IRS EUR 10Y	0,3107	0,3507



TAUX EURIBOR	05/01/2022	04/01/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,58	-0,006
EURIBOR 1M EUR	-0,57	-0,57	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,58	-0,57	-0,011
EURIBOR 6M EUR	-0,54	-0,54	-0,006
EURIBOR 12M EUR	-0,50	-0,50	-0,002
	06/01/2022	05/01/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,67	-0,69	0,016
XEU Benchmark 3Y	-0,59	-0,61	0,017
XEU Benchmark 4Y	-0,56	-0,58	0,020
XEU Benchmark 5Y	-0,26	-0,29	0,028
XEU Benchmark 6Y	-0,35	-0,37	0,023
XEU Benchmark 7Y	-0,31	-0,33	0,022
XEU Benchmark 8Y	0,04	0,02	0,024
XEU Benchmark 9Y	0,16	0,14	0,023
XEU Benchmark 10Y	0,26	0,23	0,031
XEU Benchmark 12Y	0,43	0,40	0,021
XEU Benchmark 15Y	0,09	0,08	0,013
XEU Benchmark 20Y	0,05	0,05	0,004
TEC 30	0,96	0,92	0,040

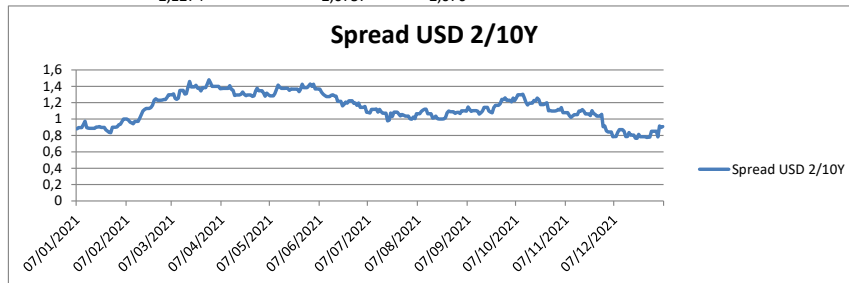
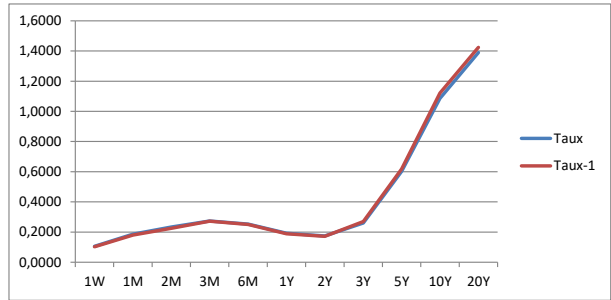


EURIBOR3M	07/01/2022	06/01/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,576						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I MAR22	100,545	100,55	-0,545		101,090	-0,550	0,031
I JUN22	100,505	100,51	-0,505		101,010	-0,510	0,071
I SEP22	100,415	100,42	-0,415		100,830	-0,420	0,161
I DEC22	100,315	100,315	-0,315		100,630	-0,315	0,261
I MAR23	100,165	100,165	-0,165		100,330	-0,165	0,411
I JUN23	100,045	100,045	-0,045		100,090	-0,045	0,531
I SEP23	99,96	99,955	0,040		99,920	0,045	0,616
I DEC23	99,89	99,89	0,110		99,780	0,110	0,686
I MAR24	99,835	99,83	0,165		99,670	0,170	0,741
I JUN24	99,78	99,78	0,220		99,560	0,220	0,796
I SEP24	99,74	99,745	0,260		99,480	0,255	0,836
I DEC24	99,71	99,72	0,290		99,420	0,280	0,866



TAUX US EMPRUNTEUR 

	30/12/2021	29/12/2021	Δ
Libor 1 Week/USD	0,0763	0,0765	0,077
LIBOR USD 1M	0,1020	0,1037	0,104
LIBOR 2M USD	0,1545	0,1583	0,158
LIBOR 3M USD	0,2256	0,2160	0,216
LIBOR 6M USD	0,3400	0,3429	0,343
	06/01/2022	05/01/2022	
USA Benchmark 1Y	0,4242	0,3798	0,380
US Benchmark 2Y	0,8577	0,7828	0,783
US Benchmark 3Y	1,1406	1,0525	1,053
US Benchmark 5Y	1,5199	1,4173	1,417
US Benchmark 10Y	1,7679	1,6799	1,680
US Benchmark 20Y	2,1537	2,1043	2,104
US Benchmark 30Y	2,1274	2,0757	2,076



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
	06/01/2022	05/01/2022	
UK Benchmark 1Y	0,7889	0,7117	0,711705
UK Benchmark 2Y	0,8139	0,7785	0,778499
UK Benchmark 3Y	0,9045	0,8466	0,846568
UK Benchmark 4Y	0,8881	0,8213	0,82128
UK Benchmark 5Y	0,9742	0,9174	0,91742
UK Benchmark 6Y	0,9705	0,8951	0,895121
UK Benchmark 7Y	1,0641	0,9889	0,988896
UK Benchmark 8Y	1,0423	0,9705	0,970529
UK Benchmark 9Y	1,0988	1,0173	1,017288
UK Benchmark 10Y	1,1393	1,0745	1,074523
UK Benchmark 12Y	1,1685	1,0899	1,089921
UK Benchmark 15Y	1,2754	1,1939	1,193925
UK Benchmark 20Y	1,3781	1,2967	1,296736

