

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,74%	1,74%	1,74	-0,001
DE Benchmark 10Y	-0,02%	-0,03%	0,05	0,026
FR Benchmark 10Y	0,30%	0,29%	0,28	0,0194
FR Benchmark 5Y	-0,16%	-0,17%	0,17	0,013
UK Benchmark 10Y	1,11%	1,10%	1,09	0,020
TEC 10	0,27			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	81,64	81,22
Petrole Brut Baril	83,99	83,72
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,5753	2,5636
Gaz naturel	4,419	4,249
Or 1 Oc	1818,05	1821,65

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1362	1,1359
EUR/JPY	131,15	131,1
EUR/GBP	0,8335	0,83344
EUR/CAD	1,42397	1,42384
EUR/CNY	7,235	7,2267
EUR/BRL	6,329	6,3232

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,99	7,08	5,76	5,88
3 mois	22,93	23,17	19,92	20,28
6 mois	53,88	54,48	47,4	48,31

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,68	-0,38
Deposît EUR 1M	-0,67	-0,37
Deposît EUR 2M	-0,66	-0,36
Deposît EUR 3M	-0,66	-0,36
Deposît EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 12M	-0,63	-0,33

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,579	11/01/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,581	11/01/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,564	11/01/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,564	11/01/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,528	11/01/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,49	11/01/2022

	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	100,535	100,54
I JUN22	100,49	100,495
I SEP22	100,4	100,405
I DEC22	100,29	100,295

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,597	-0,556
OIS EUR 3M	-0,595	-0,554
OIS EUR 6M	-0,588	-0,547
OIS EUR 1Y	-0,548	-0,507
OIS EUR 2Y	-0,386	-0,345
OIS EUR 3Y	-0,252	-0,211

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,561	-0,541
FRA EUR 2x5	-0,549	-0,529
FRA EUR 3x6	-0,534	-0,514
FRA EUR 6x9	-0,481	-0,461
FRA EUR 9x12	-0,395	-0,375
FRA EUR 3x9	-0,483	-0,463
FRA EUR 6x12	-0,407	-0,387
FRA EUR 9x15	-0,301	-0,281
FRA EUR 12x24	0,005	0,025

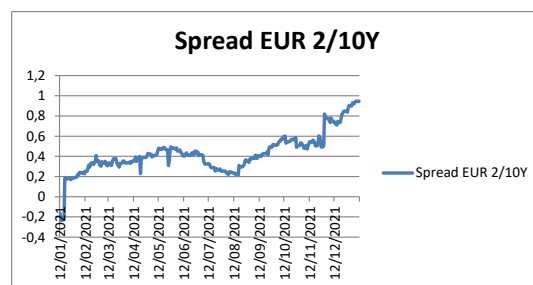
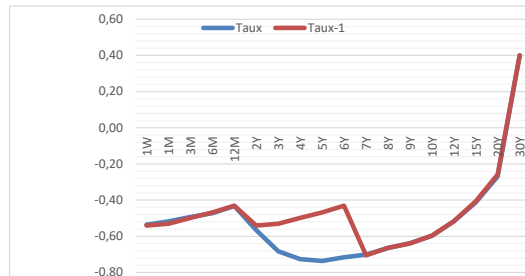
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

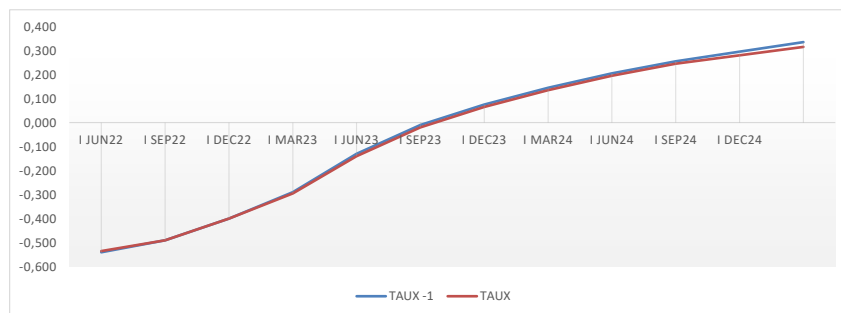
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,5101	-0,4701
IRS EUR 2Y	-0,3011	-0,2611
IRS EUR 3Y	-0,1432	-0,1032
IRS EUR 4Y	-0,0404	-0,0004
IRS EUR 5Y	0,0294	0,0694
IRS EUR 6Y	0,0858	0,1258
IRS EUR 7Y	0,1431	0,1831
IRS EUR 10Y	0,3237	0,3637



TAUX EURIBOR	11/01/2022	10/01/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,58	-0,002
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	-0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,56	-0,57	0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,53	-0,53	0,003
EURIBOR 12M EUR	-0,49	-0,49	-0,001
	11/01/2022	10/01/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,64	-0,65	0,010
XEU Benchmark 3Y	-0,55	-0,56	0,014
XEU Benchmark 4Y	-0,50	-0,52	0,018
XEU Benchmark 5Y	-0,21	-0,23	0,020
XEU Benchmark 6Y	-0,29	-0,31	0,020
XEU Benchmark 7Y	-0,26	-0,28	0,020
XEU Benchmark 8Y	0,09	0,08	0,015
XEU Benchmark 9Y	0,20	0,19	0,016
XEU Benchmark 10Y	0,30	0,29	0,016
XEU Benchmark 12Y	0,46	0,45	0,013
XEU Benchmark 15Y	0,14	0,12	0,015
XEU Benchmark 20Y	0,09	0,08	0,011
TEC 30	0,94	0,96	-0,020

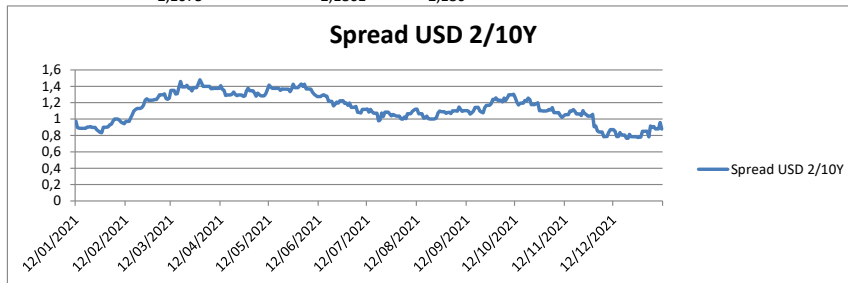
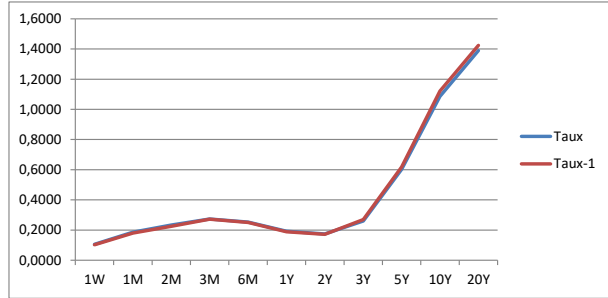



EURIBOR3M	12/01/2022	11/01/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
EURIBOR 3M EUR	-0,564						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I MAR22	100,535	100,54	-0,535		101,070	-0,540	0,029
I JUN22	100,49	100,49	-0,490		100,980	-0,490	0,074
I SEP22	100,4	100,4	-0,400		100,800	-0,400	0,164
I DEC22	100,295	100,29	-0,295		100,590	-0,290	0,269
I MAR23	100,14	100,13	-0,140		100,280	-0,130	0,424
I JUN23	100,02	100,01	-0,020		100,040	-0,010	0,544
I SEP23	99,935	99,925	0,065		99,870	0,075	0,629
I DEC23	99,865	99,855	0,135		99,730	0,145	0,699
I MAR24	99,805	99,795	0,195		99,610	0,205	0,759
I JUN24	99,755	99,745	0,245		99,510	0,255	0,809
I SEP24	99,72	99,705	0,280		99,440	0,295	0,844
I DEC24	99,685	99,665	0,315		99,370	0,335	0,879



TAUX US EMPRUNTEUR 

	10/01/2022	07/01/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0497	0,0497	0,050
SOFR 90 Day	0,0491	0,0491	0,049
SOFR 180 Day	0,0496	0,0496	0,050
	11/01/2022	10/01/2022	
USA Benchmark 1Y	0,4595	0,4426	0,443
US Benchmark 2Y	0,9167	0,8724	0,872
US Benchmark 3Y	1,2293	1,2921	1,292
US Benchmark 5Y	1,5895	1,5893	1,589
US Benchmark 10Y	1,7945	1,8308	1,831
US Benchmark 20Y	2,1494	2,1833	2,183
US Benchmark 30Y	2,1075	2,1861	2,186



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	10/01/2022	07/01/2022	Δ
SONIA	0,1948	0,1950	0,195
LIBOR 1M GBP Synth	0,2729	0,2519	0,2519
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,4994	0,4836	0,4836
LIBOR 6M/ GBP Synt	0,8255	0,8091	0,8091
	11/01/2022	10/01/2022	
UK Benchmark 1Y	0,7688	0,7671	0,767124
UK Benchmark 2Y	0,8383	0,8473	0,847276
UK Benchmark 3Y	0,9335	0,9362	0,936226
UK Benchmark 4Y	0,9240	0,9209	0,920877
UK Benchmark 5Y	1,0086	1,0203	1,020291
UK Benchmark 6Y	1,0057	1,0124	1,012379
UK Benchmark 7Y	1,0953	1,0996	1,099592
UK Benchmark 8Y	1,0710	1,0873	1,087308
UK Benchmark 9Y	1,1322	1,1382	1,138195
UK Benchmark 10Y	1,1917	1,1949	1,194902
UK Benchmark 12Y	1,2028	1,2124	1,212377
UK Benchmark 15Y	1,2882	1,3106	1,310632
UK Benchmark 20Y	1,3776	1,4081	1,408121

