

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,76%	1,76%	1,76	0,001
DE Benchmark 10Y	-0,06%	-0,07%	0,07	0,004
FR Benchmark 10Y	0,34%	0,33%	0,33	0,012
FR Benchmark 5Y	-0,15%	-0,17%	0,17	0,018
UK Benchmark 10Y	1,10%	1,09%	1,10	-0,001
TEC 10	0,27			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	85,66	85,14
Petrole Brut Baril	88,4	87,89
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,7053	2,6912
Gaz naturel	3,909	3,999
Or 1 Oc	1840,12	1833,6

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1318	1,1316
EUR/JPY	128,759	128,753
EUR/GBP	0,83556	0,8354
EUR/CAD	1,423	1,4225
EUR/CNY	7,171	7,1627
EUR/BRL	6,1746	6,1684

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,47	7,54	6,97	7,09
3 mois	24,18	24,36	21,36	21,66
6 mois	57,85	58,4	50,34	51,12

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,68	-0,38
Deposits EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 3M	-0,68	-0,38
Deposits EUR 6M	-0,67	-0,37
Deposits EUR 12M	-0,62	-0,32

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,579	21/01/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,573	21/01/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,559	21/01/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,552	21/01/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,522	21/01/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,462	21/01/2022

	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	100,475	100,48
I SEP22	100,395	100,4
I DEC22	100,305	100,31

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,597	-0,556
OIS EUR 3M	-0,594	-0,553
OIS EUR 6M	-0,585	-0,544
OIS EUR 1Y	-0,539	-0,498
OIS EUR 2Y	-0,367	-0,326
OIS EUR 3Y	-0,225	-0,184

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,552	-0,532
FRA EUR 2x5	-0,54	-0,52
FRA EUR 3x6	-0,524	-0,504
FRA EUR 6x9	-0,463	-0,443
FRA EUR 9x12	-0,386	-0,366
FRA EUR 3x9	-0,468	-0,448
FRA EUR 6x12	-0,391	-0,371
FRA EUR 9x15	-0,29	-0,27
FRA EUR 12x24	0,028	0,048

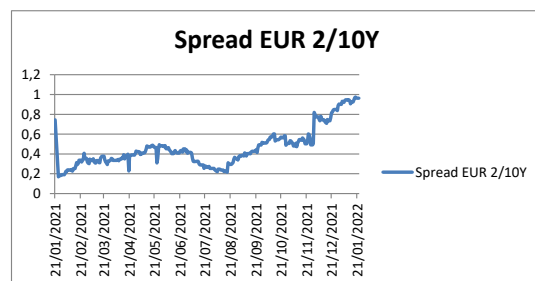
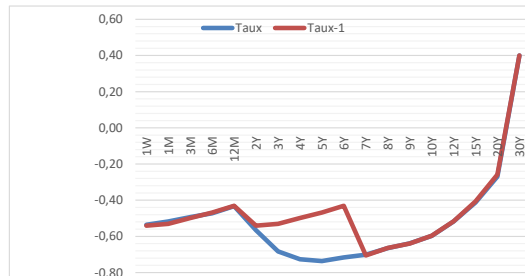
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

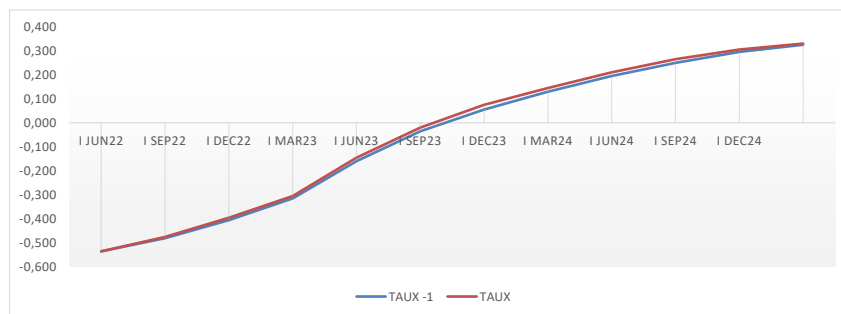
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,4987	-0,4587
IRS EUR 2Y	-0,2889	-0,2489
IRS EUR 3Y	-0,1244	-0,0844
IRS EUR 4Y	-0,0272	0,0128
IRS EUR 5Y	0,0363	0,0763
IRS EUR 6Y	0,0931	0,1331
IRS EUR 7Y	0,1539	0,1939
IRS EUR 10Y	0,3186	0,3586



TAUX EURIBOR	21/01/2022	20/01/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,58	0,004
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	0,002
EURIBOR 3M EUR	-0,55	-0,55	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,52	-0,52	-0,001
EURIBOR 12M EUR	-0,46	-0,46	-0,002
	21/01/2022	20/01/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,69	-0,65	-0,041
XEU Benchmark 3Y	-0,59	-0,55	-0,040
XEU Benchmark 4Y	-0,54	-0,50	-0,040
XEU Benchmark 5Y	-0,22	-0,19	-0,027
XEU Benchmark 6Y	-0,33	-0,29	-0,039
XEU Benchmark 7Y	-0,29	-0,25	-0,040
XEU Benchmark 8Y	0,08	0,11	-0,030
XEU Benchmark 9Y	0,18	0,22	-0,032
XEU Benchmark 10Y	0,28	0,31	-0,030
XEU Benchmark 12Y	0,44	0,47	-0,032
XEU Benchmark 15Y	0,08	0,12	-0,040
XEU Benchmark 20Y	0,02	0,06	-0,042
TEC 30	0,92	0,95	-0,030



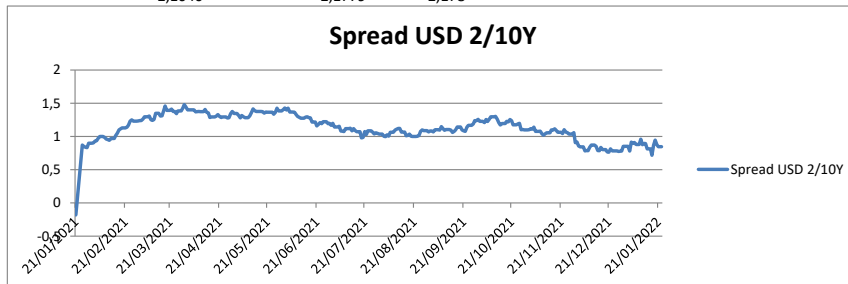
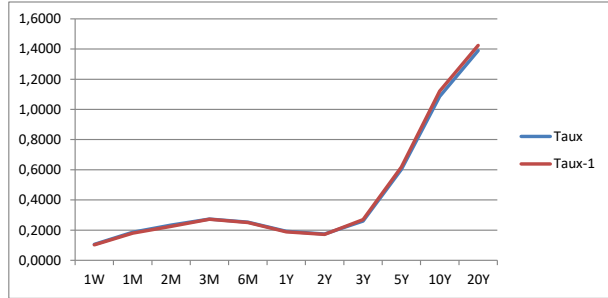
EURIBOR3M	24/01/2022	21/01/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,552					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,535	100,535	-0,535		101,070	-0,535
I JUN22	100,475	100,48	-0,475		100,950	-0,480
I SEP22	100,395	100,405	-0,395		100,790	-0,405
I DEC22	100,305	100,315	-0,305		100,610	-0,315
I MAR23	100,145	100,16	-0,145		100,290	-0,160
I JUN23	100,02	100,035	-0,020		100,040	-0,035
I SEP23	99,925	99,945	0,075		99,850	0,055
I DEC23	99,855	99,87	0,145		99,710	0,130
I MAR24	99,79	99,805	0,210		99,580	0,195
I JUN24	99,735	99,75	0,265		99,470	0,250
I SEP24	99,695	99,705	0,305		99,390	0,295
I DEC24	99,67	99,675	0,330		99,340	0,325



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	20/01/2022	19/01/2022	Δ
SOFR	0,0400	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0500	0,0497	0,050
SOFR 90 Day	0,0498	0,0496	0,050
SOFR 180 Day	0,0496	0,0496	0,050

	21/01/2022	20/01/2022	
USA Benchmark 1Y	0,5296	0,5330	0,533
US Benchmark 2Y	0,9833	1,0130	1,013
US Benchmark 3Y	1,2670	1,3220	1,322
US Benchmark 5Y	1,6487	1,7078	1,708
US Benchmark 10Y	1,8315	1,8905	1,890
US Benchmark 20Y	2,1718	2,2256	2,226
US Benchmark 30Y	2,1040	2,1779	2,178



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	20/01/2022	19/01/2022	Δ
SONIA	0,1966	0,1964	0,1964
LIBOR 1M GBP Synth	0,3602	0,3609	0,3609
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,5613	0,5602	0,5602
LIBOR 6M/ GBP Synt	0,8944	0,8890	0,889

	21/01/2022	20/01/2022	
UK Benchmark 1Y	0,8567	0,9047	0,904685
UK Benchmark 2Y	0,8761	0,9056	0,905623
UK Benchmark 3Y	0,9582	0,9781	0,978101
UK Benchmark 4Y	0,9129	0,9592	0,959163
UK Benchmark 5Y	1,0127	1,0567	1,056669
UK Benchmark 6Y	1,0041	1,0606	1,060607
UK Benchmark 7Y	1,0807	1,1462	1,146166
UK Benchmark 8Y	1,0774	1,1321	1,132123
UK Benchmark 9Y	1,1148	1,1748	1,174821
UK Benchmark 10Y	1,1902	1,2606	1,260643
UK Benchmark 12Y	1,2952	1,2564	1,256369
UK Benchmark 15Y	1,2798	1,3412	1,341153
UK Benchmark 20Y	1,3817	1,4418	1,441753

