

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,91%	1,91%	1,90	0,012
DE Benchmark 10Y	0,21%	0,20%	0,20	0,007
FR Benchmark 10Y	0,65%	0,64%	0,65	-0,0027
FR Benchmark 5Y	0,25%	0,24%	0,25	0,002
UK Benchmark 10Y	1,35%	1,34%	1,34	0,010
TEC 10	0,58			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	91,83	92,31
Petrole Brut Baril	93,24	93,27
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,9066	2,8751
Gaz naturel	4,455	4,572
Or 1 Oc	1812,831	1808,025

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1434	1,143
EUR/JPY	131,73	131,68
EUR/GBP	0,844	0,84384
EUR/CAD	1,4542	1,4537
EUR/CNY	7,2484	7,24
EUR/BRL	6,0918	6,0855

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,41	6,47	6,48	6,61
3 mois	26,85	27,05	25,48	25,83
6 mois	67,54	68,09	63,31	64,09

## MARCHÉ MONETAIRE

MARCHÉ MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,68	-0,38
Deposît EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 3M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 6M	-0,65	-0,35
Deposît EUR 12M	-0,54	-0,24

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,578	04/02/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,569	04/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,551	04/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,548	04/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,473	04/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,346	04/02/2022

	31/01/2022	31/12/2021
TMO	0,52	0,27
TME	0,32	0,07
TMM	-0,4935	-0,4924
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,566	-0,596
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,561	-0,581

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I MAR22	100,51	100,515
I JUN22	100,38	100,385
I SEP22	100,155	100,16
I DEC22	99,89	99,895

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,594	-0,553
OIS EUR 3M	-0,589	-0,548
OIS EUR 6M	-0,557	-0,516
OIS EUR 1Y	-0,402	-0,361
OIS EUR 2Y	-0,015	0,026
OIS EUR 3Y	0,169	0,21

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,533	-0,513
FRA EUR 2x5	-0,489	-0,469
FRA EUR 3x6	-0,453	-0,433
FRA EUR 6x9	-0,273	-0,253
FRA EUR 9x12	-0,035	-0,015
FRA EUR 3x9	-0,339	-0,319
FRA EUR 6x12	-0,12	-0,1
FRA EUR 9x15	0,148	0,168
FRA EUR 12x24	0,752	0,772

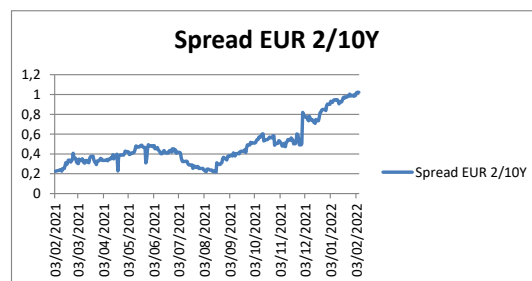
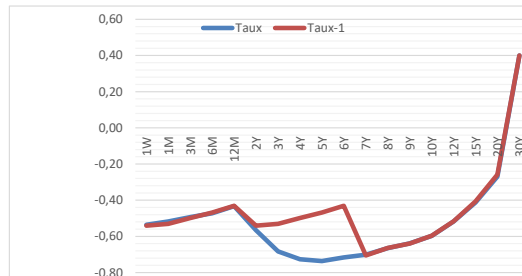
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

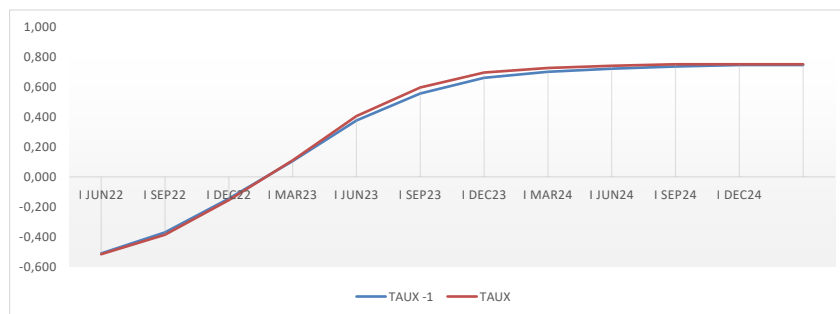
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,3454	-0,3054
IRS EUR 2Y	0,089	0,129
IRS EUR 3Y	0,2961	0,3361
IRS EUR 4Y	0,3989	0,4389
IRS EUR 5Y	0,4338	0,4738
IRS EUR 6Y	0,4649	0,5049
IRS EUR 7Y	0,5005	0,5405
IRS EUR 10Y	0,5846	0,6246



TAUX EURIBOR	04/02/2022	03/02/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,001
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,56	0,009
EURIBOR 3M EUR	-0,55	-0,55	0,003
EURIBOR 6M EUR	-0,47	-0,50	0,026
EURIBOR 12M EUR	-0,35	-0,42	0,077
	04/02/2022	03/02/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,41	-0,48	0,064
XEU Benchmark 3Y	-0,23	-0,32	0,088
XEU Benchmark 4Y	-0,16	-0,25	0,097
XEU Benchmark 5Y	0,20	0,12	0,084
XEU Benchmark 6Y	0,05	-0,04	0,090
XEU Benchmark 7Y	0,06	-0,02	0,078
XEU Benchmark 8Y	0,43	0,36	0,064
XEU Benchmark 9Y	0,51	0,45	0,061
XEU Benchmark 10Y	0,60	0,54	0,061
XEU Benchmark 12Y	0,71	0,66	0,050
XEU Benchmark 15Y	0,30	0,26	0,037
XEU Benchmark 20Y	0,20	0,17	0,035
TEC 30	1,04	1,03	0,010

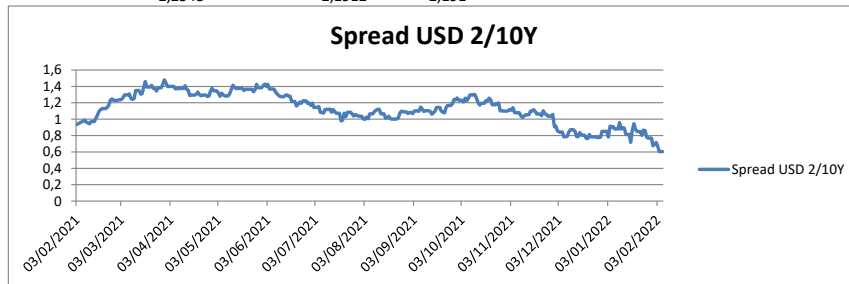
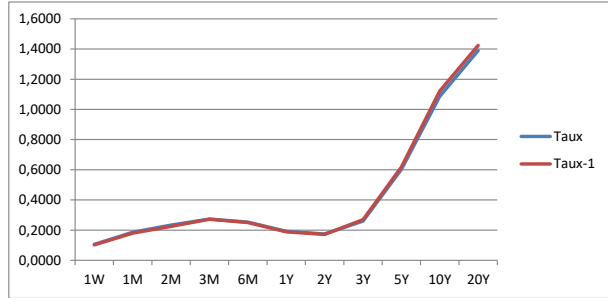


EURIBOR3M	07/02/2022	04/02/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,548					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,515	100,51	-0,515		101,030	-0,510
I JUN22	100,385	100,37	-0,385		100,770	-0,370
I SEP22	100,155	100,145	-0,155		100,310	-0,145
I DEC22	99,89	99,895	0,110		99,780	0,105
I MAR23	99,595	99,625	0,405		99,190	0,375
I JUN23	99,405	99,445	0,595		98,810	0,555
I SEP23	99,305	99,34	0,695		98,610	0,660
I DEC23	99,275	99,3	0,725		98,550	0,700
I MAR24	99,26	99,28	0,740		98,520	0,720
I JUN24	99,25	99,265	0,750		98,500	0,735
I SEP24	99,25	99,255	0,750		98,500	0,745
I DEC24	99,25	99,255	0,750		98,500	0,745



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	03/02/2022	02/02/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0487	0,0487	0,049
SOFR 90 Day	0,0495	0,0495	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049
	<b>04/02/2022</b>	<b>03/02/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	0,8251	0,7016	0,702
US Benchmark 2Y	1,2682	1,1546	1,155
US Benchmark 3Y	1,5439	1,4244	1,424
US Benchmark 5Y	1,7396	1,6640	1,664
US Benchmark 10Y	1,8745	1,8175	1,818
US Benchmark 20Y	2,3085	2,2402	2,240
US Benchmark 30Y	2,2548	2,1912	2,191



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	03/02/2022	01/02/2022	Δ
SONIA	0,4403	0,1957	0,1957
LIBOR 1M GBP Synth	0,4770	0,4016	0,4016
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,6548	0,5853	0,5853
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,0057	0,9224	0,9224
	<b>04/02/2022</b>	<b>03/02/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	1,1966	1,0373	1,03729
UK Benchmark 2Y	1,3077	1,1907	1,190726
UK Benchmark 3Y	1,3235	1,1995	1,199532
UK Benchmark 4Y	1,2667	1,1568	1,156847
UK Benchmark 5Y	1,3199	1,2391	1,23905
UK Benchmark 6Y	1,3019	1,2214	1,221376
UK Benchmark 7Y	1,3624	1,2964	1,296432
UK Benchmark 8Y	1,3196	1,2775	1,277457
UK Benchmark 9Y	1,3723	1,3257	1,32569
UK Benchmark 10Y	1,3999	1,2739	1,273907
UK Benchmark 12Y	1,4543	1,4064	1,406377
UK Benchmark 15Y	1,5187	1,4771	1,477107
UK Benchmark 20Y	1,5926	1,5637	1,563666

