

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,96%	1,96%	1,92	0,043
DE Benchmark 10Y	0,27%	0,26%	0,22	0,049
FR Benchmark 10Y	0,72%	0,71%	0,67	0,0503
FR Benchmark 5Y	0,30%	0,29%	0,25	0,052
UK Benchmark 10Y	1,42%	1,41%	1,36	0,062
TEC 10	0,64			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	89,37	89,36
Petrole Brut Baril	90,84	90,78
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,7944	2,7926
Gaz naturel	4,16	4,248
Or 1 Oc	1827,415	1825,95

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1422	1,1419
EUR/JPY	131,85	131,81
EUR/GBP	0,8425	0,8422
EUR/CAD	1,45	1,4494
EUR/CNY	7,2708	7,2624
EUR/BRL	6,011	6,0049

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	6,32	6,38	6,46	6,59
3 mois	26,78	26,98	25,23	25,57
6 mois	67,84	68,39	62,88	63,66

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,7	-0,4
Deposit EUR 1M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 3M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 6M	-0,7	-0,4
Deposit EUR 12M	-0,52	-0,22

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,574	08/02/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,573	07/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,548	07/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,53	07/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,456	07/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,31	07/02/2022

	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	100,515	100,52
I JUN22	100,395	100,4
I SEP22	100,195	100,2
I DEC22	99,945	99,95

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,588	-0,547
OIS EUR 6M	-0,56	-0,519
OIS EUR 1Y	-0,418	-0,377
OIS EUR 2Y	-0,054	-0,013
OIS EUR 3Y	0,147	0,188

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,529	-0,509
FRA EUR 2x5	-0,493	-0,473
FRA EUR 3x6	-0,455	-0,435
FRA EUR 6x9	-0,294	-0,274
FRA EUR 9x12	-0,075	-0,055
FRA EUR 3x9	-0,335	-0,315
FRA EUR 6x12	-0,131	-0,111
FRA EUR 9x15	0,118	0,138
FRA EUR 12x24	0,732	0,752

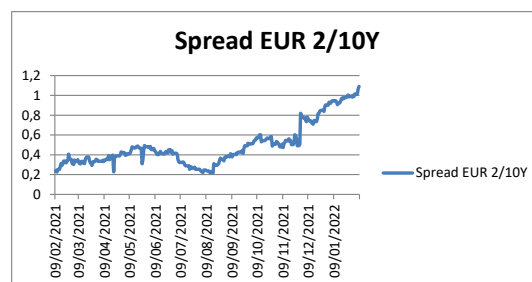
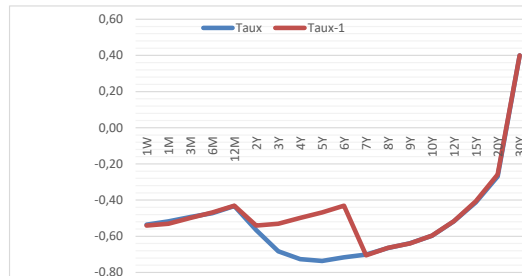
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

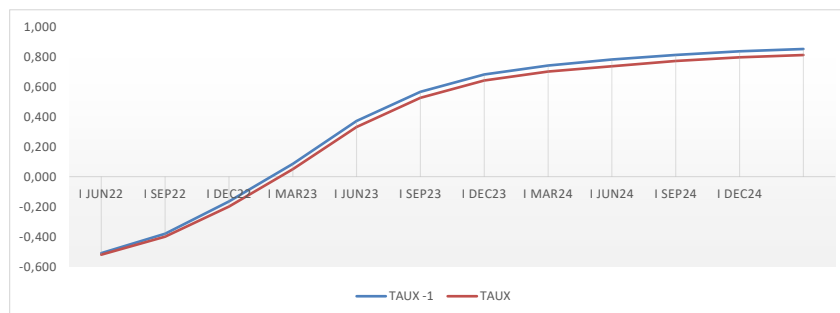
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,3611	-0,3211
IRS EUR 2Y	0,0495	0,0895
IRS EUR 3Y	0,2772	0,3172
IRS EUR 4Y	0,3959	0,4359
IRS EUR 5Y	0,4588	0,4988
IRS EUR 6Y	0,4968	0,5368
IRS EUR 7Y	0,5398	0,5798
IRS EUR 10Y	0,6461	0,6861



TAUX EURIBOR	07/02/2022	04/02/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,004
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,55	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,53	-0,55	0,018
EURIBOR 6M EUR	-0,46	-0,47	0,017
EURIBOR 12M EUR	-0,31	-0,35	0,036
	08/02/2022	07/02/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,45	-0,45	-0,007
XEU Benchmark 3Y	-0,24	-0,25	0,007
XEU Benchmark 4Y	-0,16	-0,16	0,008
XEU Benchmark 5Y	0,25	0,22	0,032
XEU Benchmark 6Y	0,09	0,06	0,030
XEU Benchmark 7Y	0,11	0,08	0,032
XEU Benchmark 8Y	0,50	0,45	0,046
XEU Benchmark 9Y	0,59	0,54	0,047
XEU Benchmark 10Y	0,67	0,62	0,045
XEU Benchmark 12Y	0,79	0,75	0,048
XEU Benchmark 15Y	0,38	0,33	0,050
XEU Benchmark 20Y	0,30	0,24	0,061
TEC 30	1,12	1,11	0,010

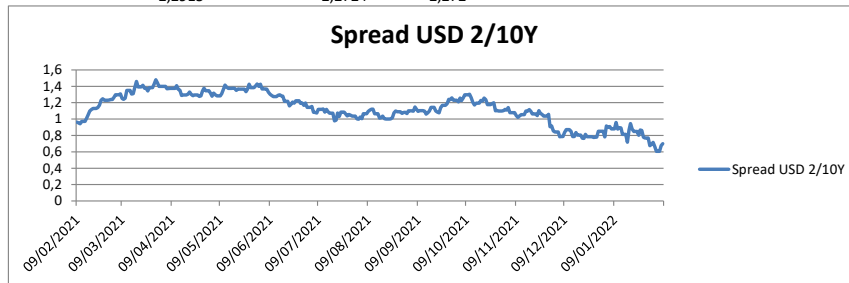
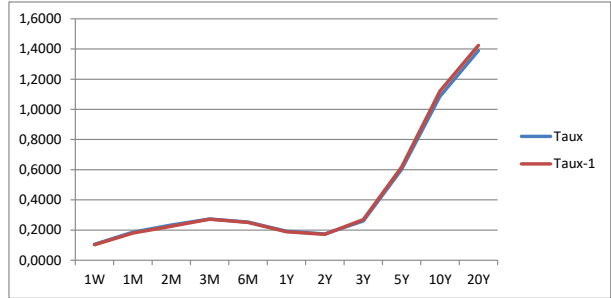


EURIBOR3M	09/02/2022	08/02/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,53					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,52	100,51	-0,520		101,040	-0,510
I JUN22	100,4	100,38	-0,400		100,800	-0,380
I SEP22	100,2	100,165	-0,200		100,400	-0,165
I DEC22	99,95	99,915	0,050		99,900	0,085
I MAR23	99,67	99,63	0,330		99,340	0,370
I JUN23	99,475	99,435	0,525		98,950	0,565
I SEP23	99,36	99,32	0,640		98,720	0,680
I DEC23	99,3	99,26	0,700		98,600	0,740
I MAR24	99,265	99,22	0,735		98,530	0,780
I JUN24	99,23	99,19	0,770		98,460	0,810
I SEP24	99,205	99,165	0,795		98,410	0,835
I DEC24	99,19	99,15	0,810		98,380	0,850



TAUX US EMPRUNTEUR 

	07/02/2022	04/02/2022	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
08/02/2022 07/02/2022			
USA Benchmark 1Y	0,8262	0,8187	0,819
US Benchmark 2Y	1,2913	1,2714	1,271
US Benchmark 3Y	1,5759	1,5504	1,550
US Benchmark 5Y	1,8697	1,8269	1,827
US Benchmark 10Y	1,9919	1,9470	1,947
US Benchmark 20Y	2,3373	2,3181	2,318
US Benchmark 30Y	2,2915	2,2724	2,272



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	04/02/2022	03/02/2022	Δ
SONIA	0,4453	0,4403	0,4403
LIBOR 1M GBP Synth	0,4776	0,4785	0,4785
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,7942	0,7442	0,7442
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,2493	1,1943	1,1943
08/02/2022 07/02/2022			
UK Benchmark 1Y	1,2659	1,2627	1,262657
UK Benchmark 2Y	1,3268	1,2830	1,283031
UK Benchmark 3Y	1,3998	1,3351	1,335093
UK Benchmark 4Y	1,3272	1,2675	1,267523
UK Benchmark 5Y	1,3961	1,3261	1,326143
UK Benchmark 6Y	1,3781	1,3043	1,304319
UK Benchmark 7Y	1,4370	1,3596	1,359591
UK Benchmark 8Y	1,4059	1,3198	1,319777
UK Benchmark 9Y	1,4531	1,3752	1,375167
UK Benchmark 10Y	1,4332	1,4135	1,413537
UK Benchmark 12Y	1,4807	1,4592	1,45923
UK Benchmark 15Y	1,6191	1,5452	1,545162
UK Benchmark 20Y	1,6999	1,6168	1,616774

