

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,04%	2,04%	2,01	0,032
DE Benchmark 10Y	0,28%	0,27%	0,27	0,007
FR Benchmark 10Y	0,74%	0,74%	0,75	-0,0011
FR Benchmark 5Y	0,24%	0,23%	0,24	0,000
UK Benchmark 10Y	1,45%	1,44%	1,43	0,021
TEC 10	0,75			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	92,9	93,66
Petrole Brut Baril	94,2	94,81
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,8375	2,8575
Gaz naturel	4,65	4,717
Or 1 Oc	1885,9165	1869,7

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1368	1,1366
EUR/JPY	130,865	130,856
EUR/GBP	0,8363	0,83625
EUR/CAD	1,4448	1,4446
EUR/CNY	7,207	7,1985
EUR/BRL	5,8434	5,8355

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,13	7,2	6,92	7,03
3 mois	30,66	30,84	27,89	28,21
6 mois	75,88	76,53	68	69,1

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,68	-0,38
Deposit EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 3M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 6M	-0,63	-0,33
Deposit EUR 12M	-0,47	-0,17

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,576	16/02/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,578	15/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,555	15/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,523	15/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,455	15/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,285	15/02/2022

	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	100,405	100,41
I SEP22	100,2	100,205
I DEC22	99,945	99,95

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,592	-0,551
OIS EUR 3M	-0,582	-0,541
OIS EUR 6M	-0,555	-0,514
OIS EUR 1Y	-0,408	-0,367
OIS EUR 2Y	-0,02	0,021
OIS EUR 3Y	0,179	0,22

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,518	-0,498
FRA EUR 2x5	-0,483	-0,463
FRA EUR 3x6	-0,446	-0,426
FRA EUR 6x9	-0,276	-0,256
FRA EUR 9x12	-0,044	-0,024
FRA EUR 3x9	-0,324	-0,304
FRA EUR 6x12	-0,091	-0,071
FRA EUR 9x15	0,169	0,189
FRA EUR 12x24	0,831	0,851

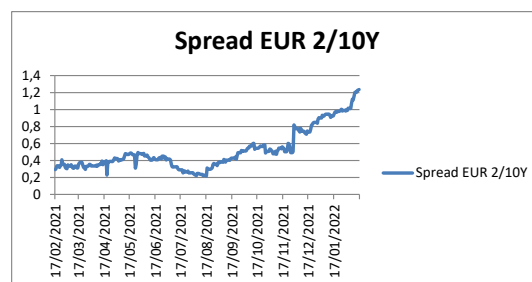
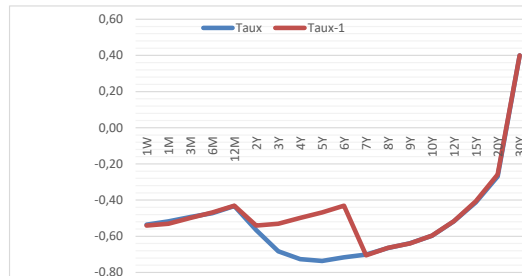
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

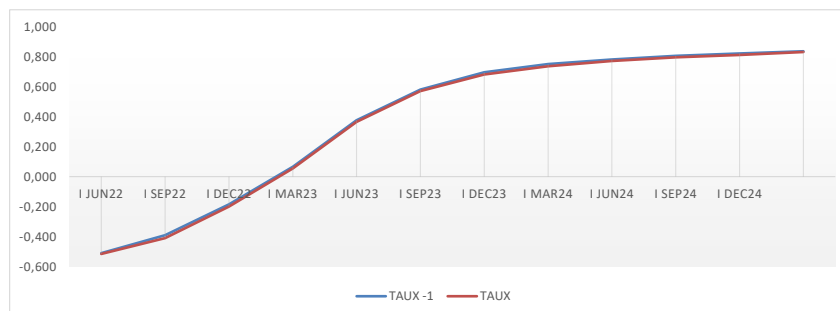
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,3457	-0,3057
IRS EUR 2Y	0,0929	0,1329
IRS EUR 3Y	0,3251	0,3651
IRS EUR 4Y	0,4431	0,4831
IRS EUR 5Y	0,5112	0,5512
IRS EUR 6Y	0,5582	0,5982
IRS EUR 7Y	0,6119	0,6519
IRS EUR 10Y	0,7519	0,7919



TAUX EURIBOR	15/02/2022	14/02/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,58	0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,55	-0,004
EURIBOR 3M EUR	-0,52	-0,52	-0,007
EURIBOR 6M EUR	-0,46	-0,45	-0,007
EURIBOR 12M EUR	-0,29	-0,28	-0,002
	16/02/2022	15/02/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,51	-0,49	-0,020
XEU Benchmark 3Y	-0,25	-0,24	-0,016
XEU Benchmark 4Y	-0,19	-0,18	-0,017
XEU Benchmark 5Y	0,21	0,23	-0,023
XEU Benchmark 6Y	0,06	0,08	-0,023
XEU Benchmark 7Y	0,09	0,11	-0,026
XEU Benchmark 8Y	0,51	0,54	-0,029
XEU Benchmark 9Y	0,61	0,64	-0,029
XEU Benchmark 10Y	0,70	0,74	-0,034
XEU Benchmark 12Y	0,84	0,87	-0,029
XEU Benchmark 15Y	0,42	0,45	-0,028
XEU Benchmark 20Y	0,36	0,39	-0,024
TEC 30	1,28	1,24	0,040

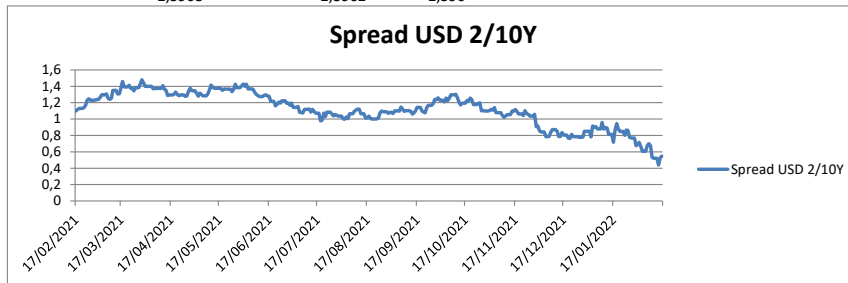
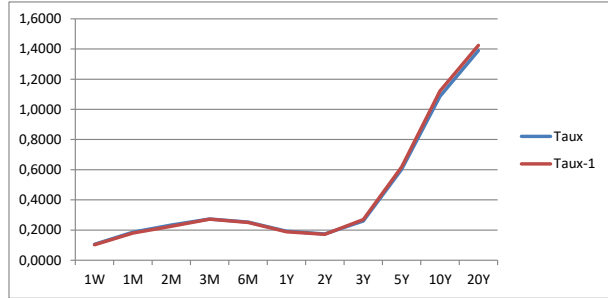



EURIBOR3M	17/02/2022	16/02/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,523					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,515	100,51	-0,515		101,030	-0,510
I JUN22	100,41	100,39	-0,410		100,820	-0,390
I SEP22	100,2	100,185	-0,200		100,400	-0,185
I DEC22	99,945	99,935	0,055		99,890	0,065
I MAR23	99,635	99,625	0,365		99,270	0,375
I JUN23	99,43	99,42	0,570		98,860	0,580
I SEP23	99,32	99,305	0,680		98,640	0,695
I DEC23	99,265	99,25	0,735		98,530	0,750
I MAR24	99,23	99,22	0,770		98,460	0,780
I JUN24	99,205	99,195	0,795		98,410	0,805
I SEP24	99,19	99,18	0,810		98,380	0,820
I DEC24	99,17	99,165	0,830		98,340	0,835



TAUX US EMPRUNTEUR 

	15/02/2022	14/02/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0483	0,0483	0,048
SOFR 90 Day	0,0493	0,0493	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049
16/02/2022 / 15/02/2022			
USA Benchmark 1Y	0,9996	1,0253	1,025
US Benchmark 2Y	1,5395	1,5681	1,568
US Benchmark 3Y	1,7842	1,8081	1,808
US Benchmark 5Y	2,0273	2,0350	2,035
US Benchmark 10Y	2,0992	2,0927	2,093
US Benchmark 20Y	2,4298	2,4296	2,430
US Benchmark 30Y	2,3968	2,3962	2,396



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	14/02/2022	11/02/2022	Δ
SONIA	0,4448	0,4452	0,4452
LIBOR 1M GBP Synth	0,4818	0,4811	0,4811
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,8910	0,8898	0,8898
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,3997	1,3855	1,3855
16/02/2022 / 15/02/2022			
UK Benchmark 1Y	1,3576	1,4618	1,461772
UK Benchmark 2Y	1,4347	1,5580	1,557969
UK Benchmark 3Y	1,4320	1,5539	1,553939
UK Benchmark 4Y	1,3475	1,4575	1,457484
UK Benchmark 5Y	1,4263	1,5452	1,545237
UK Benchmark 6Y	1,3803	1,4561	1,456083
UK Benchmark 7Y	1,4597	1,5205	1,520486
UK Benchmark 8Y	1,4206	1,4926	1,492604
UK Benchmark 9Y	1,4618	1,5208	1,520844
UK Benchmark 10Y	1,5970	1,5896	1,589611
UK Benchmark 12Y	1,6594	1,5991	1,599147
UK Benchmark 15Y	1,6424	1,6778	1,67775
UK Benchmark 20Y	1,7011	1,7332	1,73323

