

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,94%	1,94%	1,98	-0,035
DE Benchmark 10Y	0,25%	0,24%	0,25	-0,007
FR Benchmark 10Y	0,74%	0,73%	0,75	-0,0089
FR Benchmark 5Y	0,22%	0,21%	0,25	-0,025
UK Benchmark 10Y	1,39%	1,38%	1,39	-0,003
TEC 10	0,68			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	91,62	91,91
Petrole Brut Baril	96,65	96,84
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,8138	2,8188
Gaz naturel	4,49	4,498
Or 1 Oc	1892,587	1898,5

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1346	1,1343
EUR/JPY	130,541	130,534
EUR/GBP	0,83353	0,83348
EUR/CAD	1,4432	1,44267
EUR/CNY	7,168	7,1596
EUR/BRL	5,7412	5,7353

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,7	7,76	7,02	7,13
3 mois	31,86	32,04	27,25	27,57
6 mois	79,7	80,35	67,41	68,42

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	-0,64	-0,34
Deposit EUR 12M	-0,48	-0,18

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,575	22/02/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,576	21/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,556	21/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,527	21/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,482	21/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,332	21/02/2022

	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	100,505	100,51
I JUN22	100,385	100,39
I SEP22	100,185	100,19
I DEC22	99,94	99,945

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,589	-0,548
OIS EUR 6M	-0,565	-0,524
OIS EUR 1Y	-0,418	-0,377
OIS EUR 2Y	-0,011	0,03
OIS EUR 3Y	0,198	0,239

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,507	-0,487
FRA EUR 2x5	-0,48	-0,46
FRA EUR 3x6	-0,448	-0,428
FRA EUR 6x9	-0,263	-0,243
FRA EUR 9x12	-0,034	-0,014
FRA EUR 3x9	-0,328	-0,308
FRA EUR 6x12	-0,09	-0,07
FRA EUR 9x15	0,182	0,202
FRA EUR 12x24	0,697	0,717

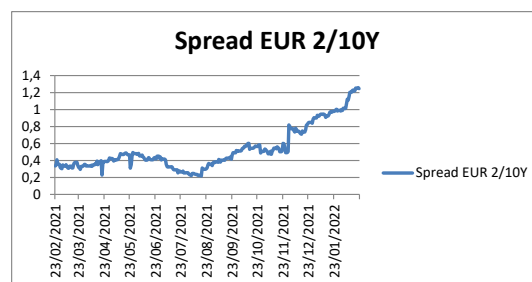
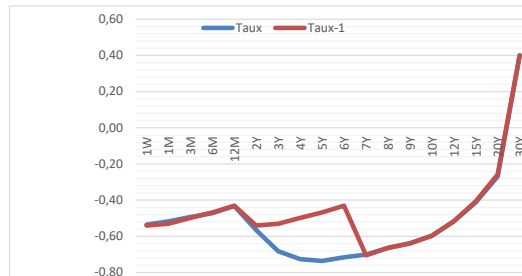
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

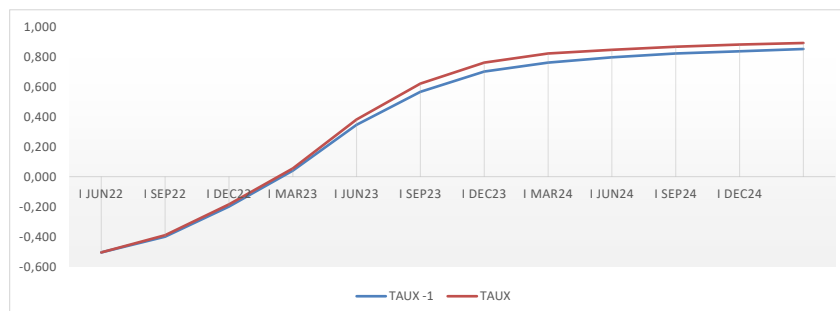
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,331	-0,291
IRS EUR 2Y	0,126	0,166
IRS EUR 3Y	0,362	0,402
IRS EUR 4Y	0,475	0,515
IRS EUR 5Y	0,54	0,58
IRS EUR 6Y	0,59	0,63
IRS EUR 7Y	0,639	0,679
IRS EUR 10Y	0,787	0,827



TAUX EURIBOR	21/02/2022	18/02/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,008
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,56	0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,53	-0,53	0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,48	-0,49	0,005
EURIBOR 12M EUR	-0,33	-0,33	-0,003
	22/02/2022	21/02/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,56	-0,59	0,035
XEU Benchmark 3Y	-0,32	-0,36	0,037
XEU Benchmark 4Y	-0,24	-0,28	0,038
XEU Benchmark 5Y	0,18	0,14	0,040
XEU Benchmark 6Y	0,00	-0,03	0,031
XEU Benchmark 7Y	0,04	0,01	0,029
XEU Benchmark 8Y	0,49	0,46	0,030
XEU Benchmark 9Y	0,59	0,57	0,026
XEU Benchmark 10Y	0,69	0,66	0,022
XEU Benchmark 12Y	0,84	0,82	0,024
XEU Benchmark 15Y	0,39	0,37	0,018
XEU Benchmark 20Y	0,32	0,30	0,014
TEC 30	1,24	1,21	0,030

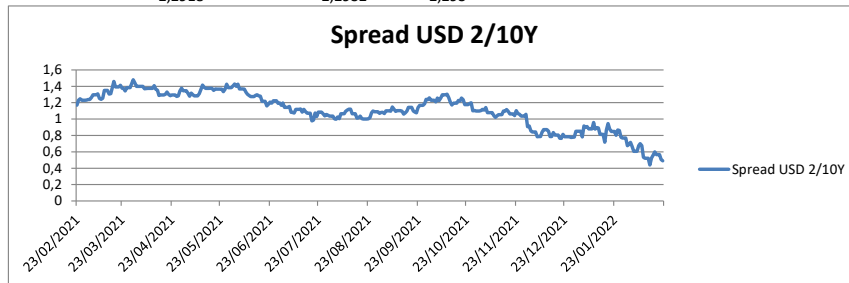
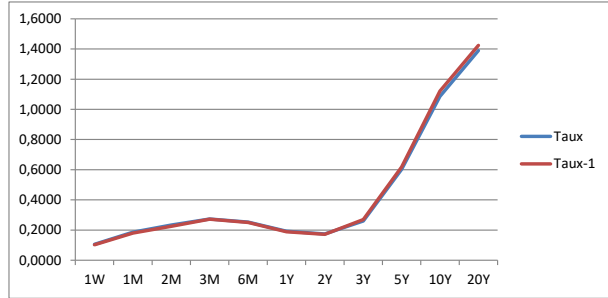


EURIBOR3M	23/02/2022	22/02/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,527					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,505	100,505	-0,505		101,010	-0,505
I JUN22	100,39	100,4	-0,390		100,780	-0,400
I SEP22	100,185	100,2	-0,185		100,370	-0,200
I DEC22	99,945	99,96	0,055		99,890	0,040
I MAR23	99,62	99,655	0,380		99,240	0,345
I JUN23	99,38	99,435	0,620		98,760	0,565
I SEP23	99,24	99,3	0,760		98,480	0,700
I DEC23	99,18	99,24	0,820		98,360	0,760
I MAR24	99,155	99,205	0,845		98,310	0,795
I JUN24	99,135	99,18	0,865		98,270	0,820
I SEP24	99,12	99,165	0,880		98,240	0,835
I DEC24	99,11	99,15	0,890		98,220	0,850



TAUX US EMPRUNTEUR 

	18/02/2022	17/02/2022	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
22/02/2022 / 21/02/2022			
USA Benchmark 1Y	0,9551	0,9163	0,916
US Benchmark 2Y	1,5142	1,4592	1,459
US Benchmark 3Y	1,7246	1,6850	1,685
US Benchmark 5Y	1,8544	1,8225	1,823
US Benchmark 10Y	1,9164	1,9645	1,965
US Benchmark 20Y	2,3588	2,3492	2,349
US Benchmark 30Y	2,2918	2,2932	2,293



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	18/02/2022	17/02/2022	Δ
SONIA	0,4453	0,4449	0,4449
LIBOR 1M GBP Synth	0,5278	0,4922	0,4922
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,8808	0,8677	0,8677
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,3314	1,3305	1,3305
22/02/2022 / 21/02/2022			
UK Benchmark 1Y	1,2152	0,9613	0,961304
UK Benchmark 2Y	1,3723	1,2851	1,285087
UK Benchmark 3Y	1,3755	1,3065	1,306481
UK Benchmark 4Y	1,3013	1,2277	1,227708
UK Benchmark 5Y	1,3736	1,3032	1,303156
UK Benchmark 6Y	1,3311	1,2461	1,246098
UK Benchmark 7Y	1,4121	1,3282	1,328159
UK Benchmark 8Y	1,3787	1,2966	1,296649
UK Benchmark 9Y	1,4137	1,3473	1,347303
UK Benchmark 10Y	1,3691	1,4316	1,431648
UK Benchmark 12Y	1,4918	1,4443	1,444325
UK Benchmark 15Y	1,6184	1,5436	1,543596
UK Benchmark 20Y	1,6699	1,6007	1,600688

