

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,97%	1,97%	1,91	0,058
DE Benchmark 10Y	0,23%	0,22%	0,17	0,064
FR Benchmark 10Y	0,71%	0,70%	0,65	0,0589
FR Benchmark 5Y	0,21%	0,20%	0,13	0,082
UK Benchmark 10Y	1,37%	1,36%	1,29	0,080
TEC 10	0,63			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	95,25	91,59
Petrole Brut Baril	101,58	97,93
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	2,9166	2,8058
Gaz naturel	4,602	4,568
Or 1 Oc	1897,85	1889,2

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1172	1,1171
EUR/JPY	129,102	129,095
EUR/GBP	0,83646	0,8364
EUR/CAD	1,42755	1,42732
EUR/CNY	7,0548	7,0464
EUR/BRL	5,7718	5,7657

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	7,42	21,73	2,9	15,78
3 mois	32,73	43,77	20,2	41,53
6 mois	79,17	91,17	63,2	76,49

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,68	-0,38
Deposît EUR 1M	-0,73	-0,43
Deposît EUR 2M	-0,73	-0,43
Deposît EUR 3M	-0,73	-0,43
Deposît EUR 6M	-0,64	-0,34
Deposît EUR 12M	-0,48	-0,18

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,575	25/02/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,558	25/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,543	25/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,528	25/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,488	25/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,348	25/02/2022

	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	100,49	100,495
I JUN22	100,43	100,435
I SEP22	100,265	100,27
I DEC22	100,045	100,05

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,594	-0,553
OIS EUR 3M	-0,59	-0,549
OIS EUR 6M	-0,574	-0,533
OIS EUR 1Y	-0,464	-0,423
OIS EUR 2Y	-0,094	-0,053
OIS EUR 3Y	0,112	0,153

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,494	-0,474
FRA EUR 2x5	-0,48	-0,46
FRA EUR 3x6	-0,463	-0,443
FRA EUR 6x9	-0,314	-0,294
FRA EUR 9x12	-0,116	-0,096
FRA EUR 3x9	-0,356	-0,336
FRA EUR 6x12	-0,162	-0,142
FRA EUR 9x15	0,095	0,115
FRA EUR 12x24	0,55	0,57

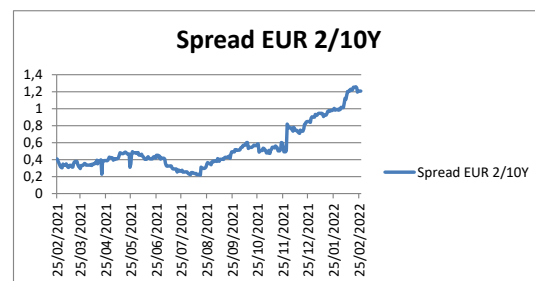
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

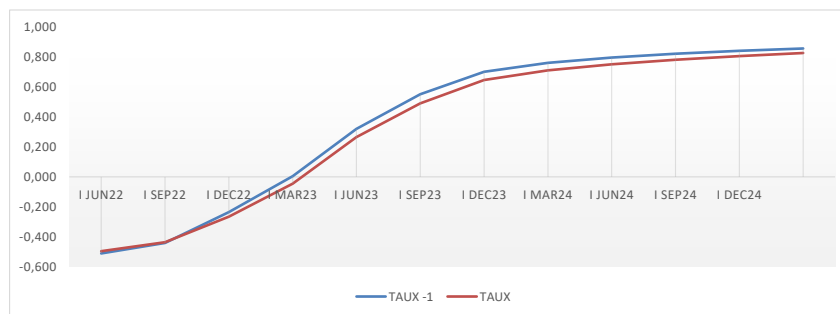
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,373	-0,333
IRS EUR 2Y	0,054	0,094
IRS EUR 3Y	0,283	0,323
IRS EUR 4Y	0,402	0,442
IRS EUR 5Y	0,47	0,51
IRS EUR 6Y	0,534	0,574
IRS EUR 7Y	0,593	0,633
IRS EUR 10Y	0,762	0,802



TAUX EURIBOR	25/02/2022	24/02/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,56	-0,58	0,018
EURIBOR 1M EUR	-0,54	-0,55	0,005
EURIBOR 3M EUR	-0,53	-0,53	0,002
EURIBOR 6M EUR	-0,49	-0,48	-0,008
EURIBOR 12M EUR	-0,35	-0,32	-0,025
XEU Benchmark 2Y	-0,54	-0,60	0,060
XEU Benchmark 3Y	-0,31	-0,38	0,071
XEU Benchmark 4Y	-0,23	-0,31	0,076
XEU Benchmark 5Y	0,17	0,11	0,053
XEU Benchmark 6Y	0,01	-0,08	0,084
XEU Benchmark 7Y	0,05	-0,04	0,084
XEU Benchmark 8Y	0,47	0,42	0,047
XEU Benchmark 9Y	0,57	0,52	0,047
XEU Benchmark 10Y	0,65	0,61	0,045
XEU Benchmark 12Y	0,81	0,76	0,043
XEU Benchmark 15Y	0,37	0,31	0,064
XEU Benchmark 20Y	0,31	0,25	0,058
TEC 30	1,18	1,17	0,010

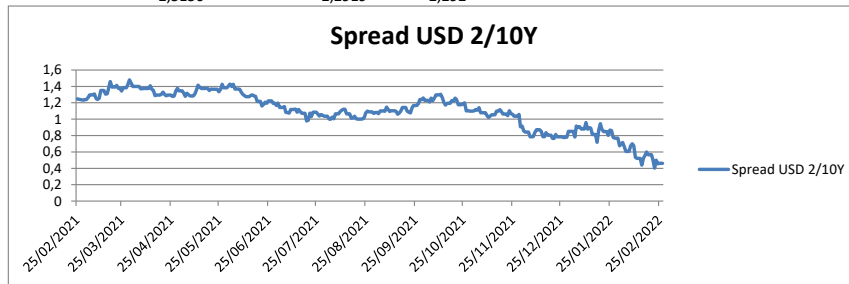
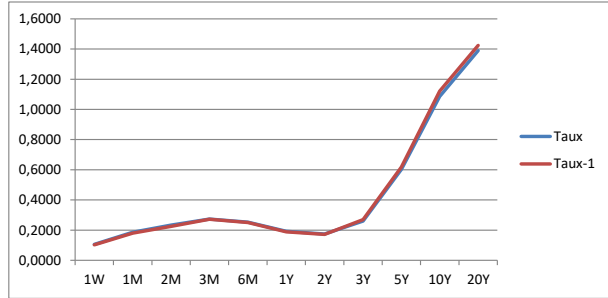



EURIBOR3M	28/02/2022	25/02/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,528					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,495	100,51	-0,495		100,990	-0,510
I JUN22	100,435	100,44	-0,435		100,870	-0,440
I SEP22	100,265	100,235	-0,265		100,530	-0,235
I DEC22	100,045	99,995	-0,045		100,090	0,005
I MAR23	99,735	99,68	0,265		99,470	0,320
I JUN23	99,51	99,45	0,490		99,020	0,550
I SEP23	99,355	99,3	0,645		98,710	0,700
I DEC23	99,29	99,24	0,710		98,580	0,760
I MAR24	99,25	99,205	0,750		98,500	0,795
I JUN24	99,22	99,18	0,780		98,440	0,820
I SEP24	99,195	99,16	0,805		98,390	0,840
I DEC24	99,175	99,145	0,825		98,350	0,855



TAUX US EMPRUNTEUR 

	24/02/2022	23/02/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0490	0,0487	0,049
SOFR 90 Day	0,0493	0,0493	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049
25/02/2022			
USA Benchmark 1Y	0,9724	0,9217	0,922
US Benchmark 2Y	1,5551	1,4763	1,476
US Benchmark 3Y	1,7819	1,7361	1,736
US Benchmark 5Y	1,9288	1,8649	1,865
US Benchmark 10Y	1,9963	1,9312	1,931
US Benchmark 20Y	2,4195	2,3806	2,381
US Benchmark 30Y	2,3156	2,2919	2,292



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	24/02/2022	23/02/2022	Δ
SONIA	0,4451	0,4451	0,4451
LIBOR 1M GBP Synth	0,5553	0,5526	0,5526
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,8538	0,8568	0,8568
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,2926	1,2956	1,2956
25/02/2022			
UK Benchmark 1Y	1,1388	1,1288	1,128781
UK Benchmark 2Y	1,2286	1,2540	1,254033
UK Benchmark 3Y	1,2719	1,3068	1,306805
UK Benchmark 4Y	1,1801	1,2262	1,226244
UK Benchmark 5Y	1,2587	1,3041	1,304062
UK Benchmark 6Y	1,2541	1,2609	1,260947
UK Benchmark 7Y	1,3407	1,3577	1,357712
UK Benchmark 8Y	1,3353	1,3366	1,336551
UK Benchmark 9Y	1,3721	1,3757	1,375651
UK Benchmark 10Y	1,4395	1,3990	1,399032
UK Benchmark 12Y	1,4888	1,4718	1,471806
UK Benchmark 15Y	1,6254	1,5999	1,599933
UK Benchmark 20Y	1,6852	1,6707	1,670655

