

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,73%	1,72%	1,73	-0,007
DE Benchmark 10Y	-0,07%	-0,08%	0,02	-0,055
FR Benchmark 10Y	0,37%	0,36%	0,43	-0,0583
FR Benchmark 5Y	-0,22%	-0,23%	0,16	-0,055
UK Benchmark 10Y	0,99%	0,99%	1,19	-0,199
TEC 10	0,49			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	109,51	103,41
Petrole Brut Baril	111,06	104,97
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,3672	3,1511
Gaz naturel	4,733	4,573
Or 1 Oc	1935,39	1945,21

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1096	1,1093
EUR/JPY	127,848	127,841
EUR/GBP	0,8343	0,83424
EUR/CAD	1,41151	1,41131
EUR/CNY	7,0066	6,9982
EUR/BRL	5,7288	5,7214

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	11,3	12,02	7,59	8,53
3 mois	36,17	37,25	28,33	29,9
6 mois	77,84	83,84	65,54	72,2

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,77	-0,47
Deposit EUR 2M	-0,76	-0,46
Deposit EUR 3M	-0,76	-0,46
Deposit EUR 6M	-0,64	-0,34
Deposit EUR 12M	-0,54	-0,24

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,577	01/03/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,567	28/02/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,551	28/02/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,533	28/02/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,493	28/02/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,349	28/02/2022

	28/02/2022	31/01/2022
TMO	0,88	0,52
TME	0,68	0,32
TMM	-0,4916	-0,4935
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,553	-0,566
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,532	-0,561

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I MAR22	100,515	100,52
I JUN22	100,465	100,47
I SEP22	100,355	100,365
I DEC22	100,215	100,22

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,592	-0,551
OIS EUR 6M	-0,578	-0,537
OIS EUR 1Y	-0,504	-0,463
OIS EUR 2Y	-0,242	-0,201
OIS EUR 3Y	-0,088	-0,047

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,514	-0,494
FRA EUR 2x5	-0,499	-0,479
FRA EUR 3x6	-0,481	-0,461
FRA EUR 6x9	-0,371	-0,351
FRA EUR 9x12	-0,234	-0,214
FRA EUR 3x9	-0,39	-0,37
FRA EUR 6x12	-0,252	-0,232
FRA EUR 9x15	-0,06	-0,04
FRA EUR 12x24	0,229	0,249

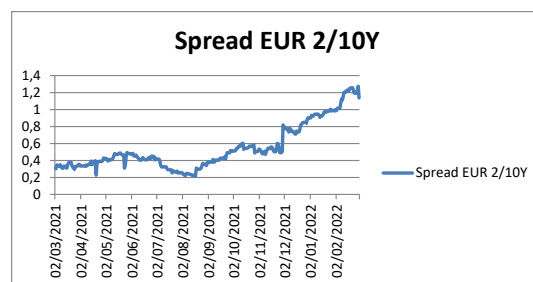
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

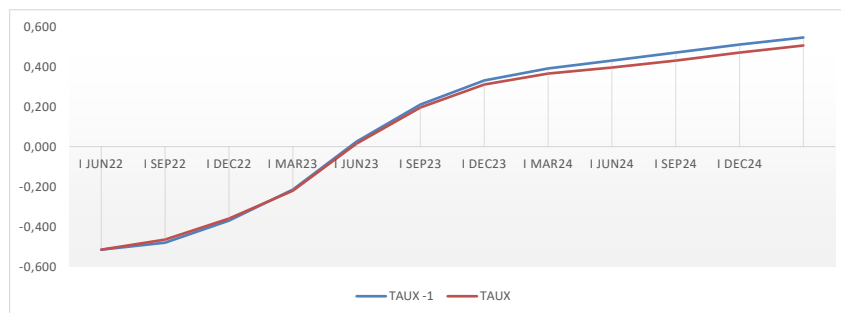
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,423	-0,383
IRS EUR 2Y	-0,111	-0,071
IRS EUR 3Y	0,067	0,107
IRS EUR 4Y	0,195	0,235
IRS EUR 5Y	0,288	0,328
IRS EUR 6Y	0,362	0,402
IRS EUR 7Y	0,43	0,47
IRS EUR 10Y	0,628	0,668



	28/02/2022	25/02/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,56	-0,009
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,54	-0,008
EURIBOR 3M EUR	-0,53	-0,53	-0,005
EURIBOR 6M EUR	-0,49	-0,49	-0,005
EURIBOR 12M EUR	-0,35	-0,35	-0,001
	01/03/2022	28/02/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,84	-0,71	-0,129
XEU Benchmark 3Y	-0,66	-0,51	-0,154
XEU Benchmark 4Y	-0,61	-0,44	-0,168
XEU Benchmark 5Y	-0,29	0,02	-0,302
XEU Benchmark 6Y	-0,37	-0,18	-0,184
XEU Benchmark 7Y	-0,31	-0,13	-0,183
XEU Benchmark 8Y	0,09	0,37	-0,278
XEU Benchmark 9Y	0,20	0,47	-0,265
XEU Benchmark 10Y	0,29	0,56	-0,268
XEU Benchmark 12Y	0,50	0,73	-0,229
XEU Benchmark 15Y	0,11	0,27	-0,160
XEU Benchmark 20Y	0,08	0,23	-0,157
TEC 30	1,10	1,20	-0,100

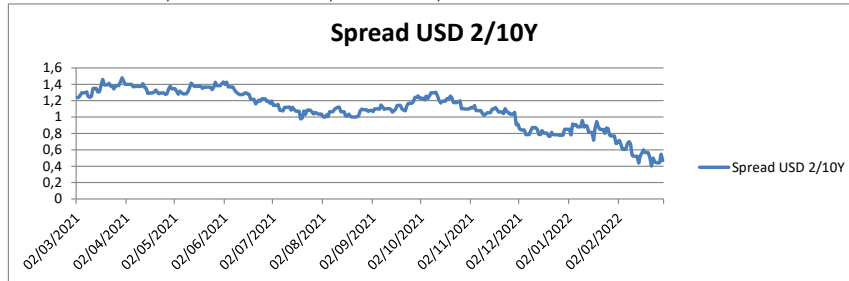
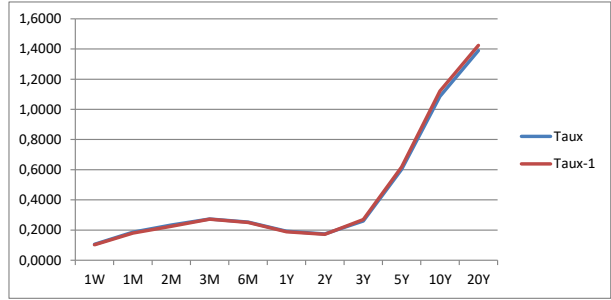


EURIBOR3M	02/03/2022	01/03/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,533					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,515	100,515	-0,515		101,030	-0,515
I JUN22	100,465	100,48	-0,465		100,930	-0,480
I SEP22	100,36	100,37	-0,360		100,720	-0,370
I DEC22	100,22	100,215	-0,220		100,440	-0,215
I MAR23	99,985	99,975	0,015		99,970	0,025
I JUN23	99,805	99,79	0,195		99,610	0,210
I SEP23	99,69	99,67	0,310		99,380	0,330
I DEC23	99,635	99,61	0,365		99,270	0,390
I MAR24	99,605	99,57	0,395		99,210	0,430
I JUN24	99,57	99,53	0,430		99,140	0,470
I SEP24	99,53	99,49	0,470		99,060	0,510
I DEC24	99,495	99,455	0,505		98,990	0,545



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	28/02/2022	25/02/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0497	0,0490	0,049
SOFR 90 Day	0,0493	0,0493	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049
<b>01/03/2022</b>			
USA Benchmark 1Y	0,8771	0,9003	0,900
US Benchmark 2Y	1,2849	1,4142	1,414
US Benchmark 3Y	1,5059	1,6583	1,658
US Benchmark 5Y	1,8251	1,8838	1,884
US Benchmark 10Y	1,8916	1,9609	1,961
US Benchmark 20Y	2,2222	2,3463	2,346
US Benchmark 30Y	2,1394	2,2534	2,253



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	25/02/2022	24/02/2022	Δ
SONIA	0,4449	0,4451	0,4451
LIBOR 1M GBP Synth	0,6019	0,5553	0,5553
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,8780	0,8538	0,8538
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,3081	1,2926	1,2926
<b>01/03/2022</b>			
UK Benchmark 1Y	1,0844	1,0523	1,05231
UK Benchmark 2Y	0,8914	1,0895	1,089545
UK Benchmark 3Y	0,9340	1,1616	1,161567
UK Benchmark 4Y	0,8385	1,0597	1,059695
UK Benchmark 5Y	0,8652	1,1257	1,125702
UK Benchmark 6Y	0,9208	1,1631	1,16308
UK Benchmark 7Y	1,0309	1,2828	1,282759
UK Benchmark 8Y	0,9797	1,2606	1,260633
UK Benchmark 9Y	1,0695	1,3387	1,338719
UK Benchmark 10Y	1,3964	1,4118	1,411841
UK Benchmark 12Y	1,1816	1,4604	1,460417
UK Benchmark 15Y	1,3796	1,6278	1,627766
UK Benchmark 20Y	1,4706	1,7098	1,709849

