

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	1,77%	1,77%	1,81	-0,036
DE Benchmark 10Y	-0,02%	-0,02%	0,02	0,000
FR Benchmark 10Y	0,48%	0,47%	0,51	-0,0332
FR Benchmark 5Y	-0,09%	-0,10%	0,05	-0,033
UK Benchmark 10Y	1,31%	1,30%	1,32	-0,017
TEC 10	0,44			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	121,66	119,4
Petrole Brut Baril	126,14	123,21
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,0513	3,9215
Gaz naturel	4,691	4,833
Or 1 Oc	2017,445	1998,11

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0892	1,0889
EUR/JPY	125,702	125,688
EUR/GBP	0,83065	0,83056
EUR/CAD	1,39614	1,39565
EUR/CNY	6,8824	6,8743
EUR/BRL	5,571	5,5641

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	11,97	12,51	9,14	9,9
3 mois	37,14	37,98	31,85	33,07
6 mois	86,98	91,48	76,98	82,05

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,71	-0,41
Deposît EUR 1M	-0,78	-0,48
Deposît EUR 2M	-0,74	-0,44
Deposît EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposît EUR 6M	-0,66	-0,36
Deposît EUR 12M	-0,54	-0,24

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,579	07/03/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,567	04/03/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,546	04/03/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,52	04/03/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,482	04/03/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,359	04/03/2022

	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	100,44	100,445
I JUN22	100,305	100,31
I SEP22	100,22	100,225
I DEC22	100,065	100,07

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,596	-0,555
OIS EUR 3M	-0,595	-0,554
OIS EUR 6M	-0,58	-0,539
OIS EUR 1Y	-0,478	-0,437
OIS EUR 2Y	-0,174	-0,133
OIS EUR 3Y	-0,025	0,016

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,419	-0,399
FRA EUR 2x5	-0,379	-0,359
FRA EUR 3x6	-0,33	-0,31
FRA EUR 6x9	-0,234	-0,214
FRA EUR 9x12	-0,088	-0,068
FRA EUR 3x9	-0,291	-0,271
FRA EUR 6x12	-0,131	-0,111
FRA EUR 9x15	0,08	0,1
FRA EUR 12x24	0,472	0,492

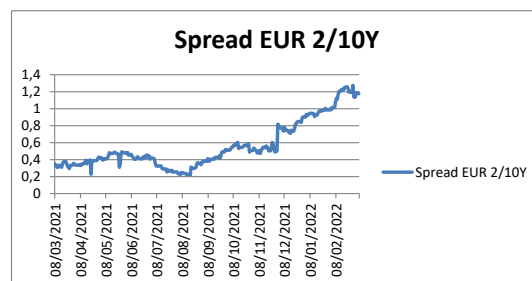
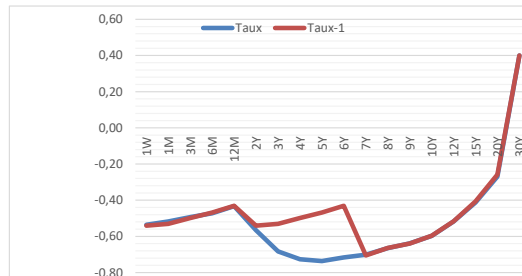
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

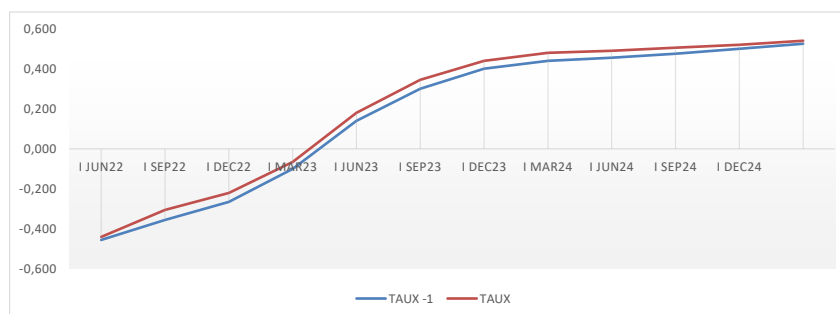
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,311	-0,271
IRS EUR 2Y	0,015	0,055
IRS EUR 3Y	0,173	0,213
IRS EUR 4Y	0,307	0,347
IRS EUR 5Y	0,416	0,456
IRS EUR 6Y	0,487	0,527
IRS EUR 7Y	0,553	0,593
IRS EUR 10Y	0,745	0,785



TAUX EURIBOR	04/03/2022	03/03/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,55	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,52	-0,53	0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,48	-0,49	0,003
EURIBOR 12M EUR	-0,36	-0,38	0,018
	07/03/2022	04/03/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,78	-0,83	0,048
XEU Benchmark 3Y	-0,61	-0,67	0,059
XEU Benchmark 4Y	-0,56	-0,60	0,040
XEU Benchmark 5Y	-0,16	-0,20	0,048
XEU Benchmark 6Y	-0,30	-0,35	0,041
XEU Benchmark 7Y	-0,26	-0,30	0,041
XEU Benchmark 8Y	0,18	0,15	0,034
XEU Benchmark 9Y	0,29	0,26	0,032
XEU Benchmark 10Y	0,40	0,36	0,036
XEU Benchmark 12Y	0,57	0,55	0,023
XEU Benchmark 15Y	0,11	0,08	0,030
XEU Benchmark 20Y	0,02	0,01	0,013
TEC 30	1,06	1,13	-0,070

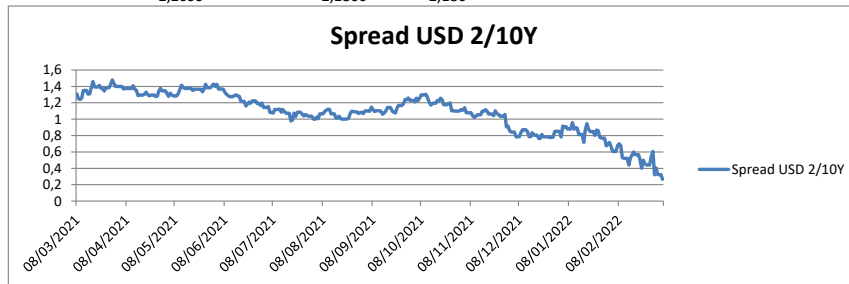
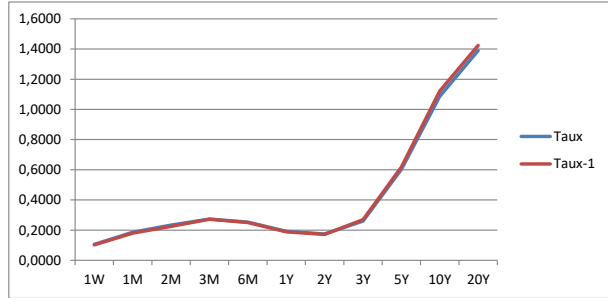



EURIBOR3M	08/03/2022	07/03/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,52					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22	100,44	100,455	-0,440		100,880	-0,455
I JUN22	100,305	100,355	-0,305		100,610	-0,355
I SEP22	100,22	100,265	-0,220		100,440	-0,265
I DEC22	100,065	100,1	-0,065		100,130	-0,100
I MAR23	99,82	99,86	0,180		99,640	0,140
I JUN23	99,655	99,7	0,345		99,310	0,300
I SEP23	99,56	99,6	0,440		99,120	0,400
I DEC23	99,52	99,56	0,480		99,040	0,440
I MAR24	99,51	99,545	0,490		99,020	0,455
I JUN24	99,495	99,525	0,505		98,990	0,475
I SEP24	99,48	99,5	0,520		98,960	0,500
I DEC24	99,46	99,475	0,540		98,920	0,525



TAUX US EMPRUNTEUR 

	04/03/2022	02/03/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0497	0,0497	0,050
SOFR 90 Day	0,0493	0,0493	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049
07/03/2022 04/03/2022			
USA Benchmark 1Y	0,9606	0,9126	0,913
US Benchmark 2Y	1,4978	1,4356	1,436
US Benchmark 3Y	1,6903	1,6092	1,609
US Benchmark 5Y	1,7049	1,7815	1,781
US Benchmark 10Y	1,7641	1,7582	1,758
US Benchmark 20Y	2,2962	2,2467	2,247
US Benchmark 30Y	2,2099	2,1860	2,186



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	03/03/2022	02/03/2022	Δ
SONIA	0,4452	0,4450	0,445
LIBOR 1M GBP Synth	0,6481	0,6488	0,6488
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,9375	0,9475	0,9475
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,3651	1,3902	1,3902
07/03/2022 04/03/2022			
UK Benchmark 1Y	1,1299	1,1610	1,161024
UK Benchmark 2Y	1,2143	1,1090	1,109021
UK Benchmark 3Y	1,2073	1,1056	1,105613
UK Benchmark 4Y	1,0752	0,9776	0,977602
UK Benchmark 5Y	1,1620	1,0430	1,042983
UK Benchmark 6Y	1,1025	1,0148	1,01482
UK Benchmark 7Y	1,1704	1,0769	1,076855
UK Benchmark 8Y	1,1632	1,0531	1,053146
UK Benchmark 9Y	1,1826	1,0947	1,09467
UK Benchmark 10Y	1,1941	1,2642	1,264216
UK Benchmark 12Y	1,3182	1,2125	1,212546
UK Benchmark 15Y	1,4702	1,3960	1,396045
UK Benchmark 20Y	1,5580	1,4920	1,491976

