

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,16%	2,16%	2,18	-0,013
DE Benchmark 10Y	0,39%	0,38%	0,40	-0,013
FR Benchmark 10Y	0,84%	0,84%	0,85	-0,0026
FR Benchmark 5Y	0,32%	0,31%	0,32	0,005
UK Benchmark 10Y	1,57%	1,56%	1,58	-0,009
TEC 10	0,79			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	104,13	102,98
Petrole Brut Baril	107,36	106,64
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,5098	3,4874
Gaz naturel	4,831	4,99
Or 1 Oc	1934,385	1942,745

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,1077	1,1074
EUR/JPY	131,702	131,68
EUR/GBP	0,84222	0,84217
EUR/CAD	1,3975	1,3935
EUR/CNY	7,053	7,0449
EUR/BRL	5,5876	5,5806

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	10,68	11,02	9,4	10,06
3 mois	37,14	37,68	32,09	33,18
6 mois	89,77	91,77	73,47	76,92

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,71	-0,41
Deposits EUR 1M	-0,75	-0,45
Deposits EUR 2M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,61	-0,31
Deposits EUR 12M	-0,44	-0,14

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,578	17/03/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,569	16/03/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,554	16/03/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,488	16/03/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,393	16/03/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,232	16/03/2022

	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 TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I MAR22		
I JUN22	100,355	100,36
I SEP22	100,155	100,165
I DEC22	99,91	99,915

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,592	-0,551
OIS EUR 6M	-0,544	-0,503
OIS EUR 1Y	-0,369	-0,328
OIS EUR 2Y	0,038	0,079
OIS EUR 3Y	0,23	0,271

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,449	-0,429
FRA EUR 2x5	-0,401	-0,381
FRA EUR 3x6	-0,355	-0,335
FRA EUR 6x9	-0,158	-0,138
FRA EUR 9x12	0,102	0,122
FRA EUR 3x9	-0,213	-0,193
FRA EUR 6x12	0,036	0,056
FRA EUR 9x15	0,336	0,356
FRA EUR 12x24	0,872	0,892

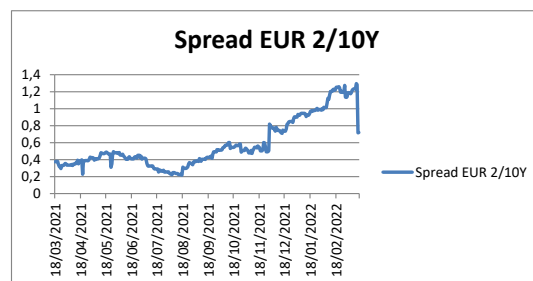
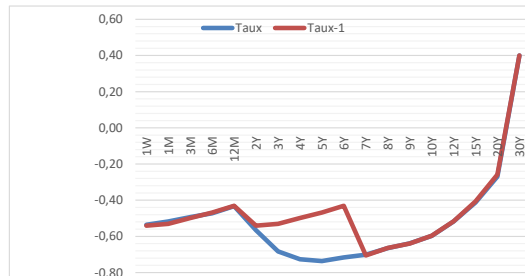
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

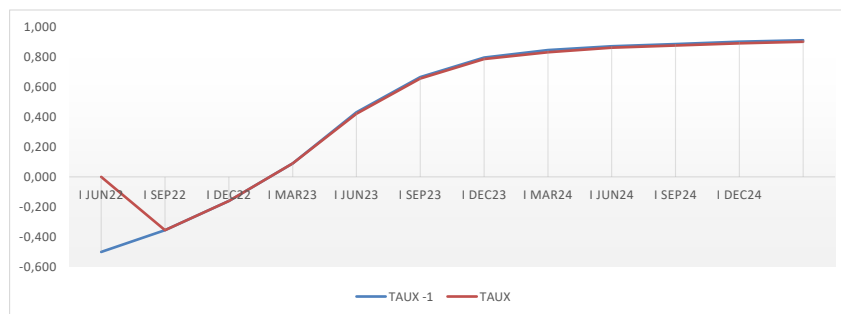
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,242	-0,202
IRS EUR 2Y	0,204	0,244
IRS EUR 3Y	0,419	0,459
IRS EUR 4Y	0,552	0,592
IRS EUR 5Y	0,651	0,691
IRS EUR 6Y	0,717	0,757
IRS EUR 7Y	0,776	0,816
IRS EUR 10Y	0,957	0,997



TAUX EURIBOR	16/03/2022	15/03/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,002
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,55	-0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,49	-0,50	0,014
EURIBOR 6M EUR	-0,39	-0,41	0,014
EURIBOR 12M EUR	-0,23	-0,24	0,005
	17/03/2022	16/03/2022	
XEU Benchmark 2Y	-0,33	-0,33	-0,005
XEU Benchmark 3Y	-0,17	-0,17	0,000
XEU Benchmark 4Y	0,14	0,15	-0,008
XEU Benchmark 5Y	0,30	0,30	-0,002
XEU Benchmark 6Y	0,13	0,12	0,007
XEU Benchmark 7Y	0,19	0,18	0,006
XEU Benchmark 8Y	0,24	0,24	0,003
XEU Benchmark 9Y	0,31	0,31	0,001
XEU Benchmark 10Y	0,39	0,39	0,000
XEU Benchmark 12Y	0,97	0,98	-0,013
XEU Benchmark 15Y	0,55	0,55	0,000
XEU Benchmark 20Y	0,47	0,47	-0,002
TEC 30	1,28	1,34	-0,060



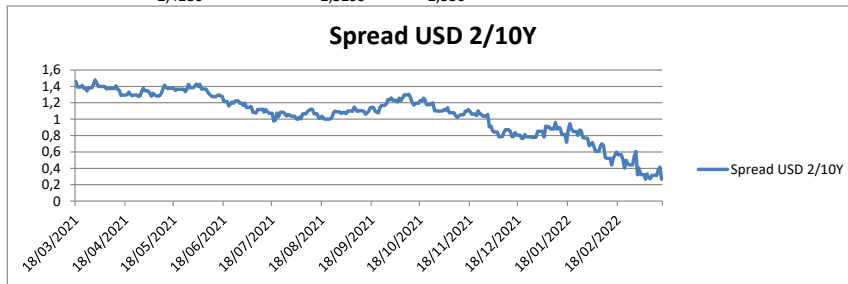
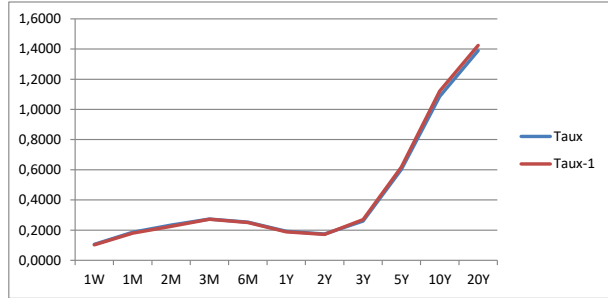
EURIBOR3M	14/03/2022	14/03/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,488					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22		100,5	#VALEUR!		#VALEUR!	-0,500
I JUN22	100,355	100,355	-0,355		100,710	-0,355
I SEP22	100,16	100,16	-0,160		100,320	-0,160
I DEC22	99,91	99,91	0,090		99,820	0,090
I MAR23	99,58	99,57	0,420		99,160	0,430
I JUN23	99,345	99,335	0,655		98,690	0,665
I SEP23	99,215	99,205	0,785		98,430	0,795
I DEC23	99,17	99,155	0,830		98,340	0,845
I MAR24	99,14	99,13	0,860		98,280	0,870
I JUN24	99,125	99,115	0,875		98,250	0,885
I SEP24	99,11	99,1	0,890		98,220	0,900
I DEC24	99,1	99,09	0,900		98,200	0,910




TAUX US EMPRUNTEUR 

	16/03/2022	15/03/2022	Δ
SOFR	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 30 Day	0,0500	0,0500	0,050
SOFR 90 Day	0,0493	0,0493	0,049
SOFR 180 Day	0,0493	0,0493	0,049

	17/03/2022	16/03/2022	
USA Benchmark 1Y	1,3318	1,1166	1,117
US Benchmark 2Y	1,9331	1,8200	1,820
US Benchmark 3Y	2,1396	2,0763	2,076
US Benchmark 5Y	2,1561	2,2269	2,227
US Benchmark 10Y	2,2007	2,2345	2,235
US Benchmark 20Y	2,5585	2,5709	2,571
US Benchmark 30Y	2,4280	2,5299	2,530



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	15/03/2022	14/03/2022	Δ
SONIA	0,4450	0,4445	0,4445
LIBOR 1M GBP Synth	0,7859	0,7779	0,7779
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,0426	1,0366	1,0366
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,5305	1,5241	1,5241

	17/03/2022	16/03/2022	
UK Benchmark 1Y	1,3600	1,3480	1,348012
UK Benchmark 2Y	1,3793	1,4669	1,466913
UK Benchmark 3Y	1,4348	1,5369	1,536928
UK Benchmark 4Y	1,2613	1,3881	1,388056
UK Benchmark 5Y	1,3600	1,4528	1,452826
UK Benchmark 6Y	1,3673	1,4509	1,450884
UK Benchmark 7Y	1,4432	1,5215	1,521518
UK Benchmark 8Y	1,4231	1,4934	1,493434
UK Benchmark 9Y	1,5846	1,6115	1,611549
UK Benchmark 10Y	1,5829	1,6633	1,663327
UK Benchmark 12Y	1,6896	1,7640	1,764015
UK Benchmark 15Y	1,7434	1,8066	1,806641
UK Benchmark 20Y	1,8284	1,8779	1,877854

