

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,15%	2,15%	2,19	-0,039
DE Benchmark 10Y	0,37%	0,36%	0,40	-0,027
FR Benchmark 10Y	0,83%	0,82%	0,86	-0,0275
FR Benchmark 5Y	0,29%	0,28%	0,32	-0,021
UK Benchmark 10Y	1,50%	1,49%	1,53	-0,032
TEC 10	0,79			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	109	104,7
Petrole Brut Baril	112,16	107,93
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,7102	3,5981
Gaz naturel	4,918	4,863
Or 1 Oc	1923,935	1921,9

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,106	1,1057
EUR/JPY	131,826	131,819
EUR/GBP	0,84027	0,84022
EUR/CAD	1,39296	1,39278
EUR/CNY	7,0386	7,0303
EUR/BRL	5,559	5,5522

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	11,28	11,54	10,11	10,48
3 mois	37,4	37,81	32,32	32,92
6 mois	92,05	93,55	73,95	75,91

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,71	-0,41
Deposits EUR 1M	-0,73	-0,43
Deposits EUR 2M	-0,73	-0,43
Deposits EUR 3M	-0,73	-0,43
Deposits EUR 6M	-0,61	-0,31
Deposits EUR 12M	-0,45	-0,15

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,578	18/03/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,566	18/03/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,557	18/03/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,487	18/03/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,393	18/03/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,207	18/03/2022

	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		
I JUN22	100,35	100,355
I SEP22	100,14	100,145
I DEC22	99,885	99,89

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,596	-0,555
OIS EUR 3M	-0,592	-0,551
OIS EUR 6M	-0,543	-0,502
OIS EUR 1Y	-0,358	-0,317
OIS EUR 2Y	0,055	0,096
OIS EUR 3Y	0,244	0,285

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,449	-0,429
FRA EUR 2x5	-0,404	-0,384
FRA EUR 3x6	-0,357	-0,337
FRA EUR 6x9	-0,153	-0,133
FRA EUR 9x12	0,111	0,131
FRA EUR 3x9	-0,197	-0,177
FRA EUR 6x12	0,059	0,079
FRA EUR 9x15	0,353	0,373
FRA EUR 12x24	0,908	0,928

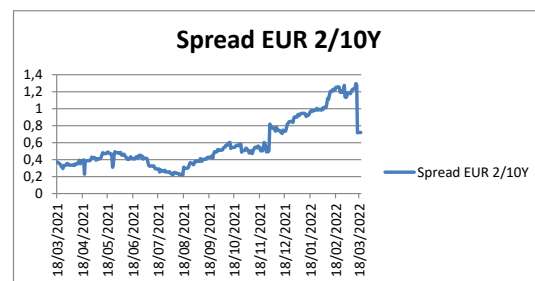
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

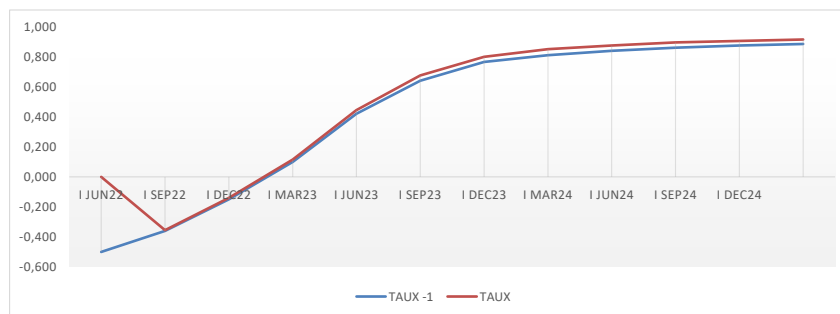
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,239	-0,199
IRS EUR 2Y	0,221	0,261
IRS EUR 3Y	0,436	0,476
IRS EUR 4Y	0,566	0,606
IRS EUR 5Y	0,659	0,699
IRS EUR 6Y	0,724	0,764
IRS EUR 7Y	0,781	0,821
IRS EUR 10Y	0,959	0,999



TAUX EURIBOR	18/03/2022	17/03/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,001
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,55	-0,009
EURIBOR 3M EUR	-0,49	-0,49	0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,39	-0,40	0,009
EURIBOR 12M EUR	-0,21	-0,22	0,009
XEU Benchmark 2Y	-0,34	-0,33	-0,005
XEU Benchmark 3Y	-0,18	-0,17	-0,010
XEU Benchmark 4Y	0,13	0,14	-0,013
XEU Benchmark 5Y	0,29	0,30	-0,012
XEU Benchmark 6Y	0,11	0,13	-0,018
XEU Benchmark 7Y	0,17	0,19	-0,020
XEU Benchmark 8Y	0,22	0,24	-0,021
XEU Benchmark 9Y	0,29	0,31	-0,022
XEU Benchmark 10Y	0,37	0,39	-0,014
XEU Benchmark 12Y	0,96	0,97	-0,008
XEU Benchmark 15Y	0,53	0,55	-0,022
XEU Benchmark 20Y	0,45	0,47	-0,016
TEC 30	1,28	1,34	-0,060



EURIBOR3M	14/03/2022	14/03/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,487					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I MAR22		100,5	#VALEUR!		#VALEUR!	-0,500
I JUN22	100,355	100,36	-0,355		100,710	-0,360
I SEP22	100,14	100,15	-0,140		100,280	-0,150
I DEC22	99,885	99,9	0,115		99,770	0,100
I MAR23	99,555	99,58	0,445		99,110	0,420
I JUN23	99,325	99,36	0,675		98,650	0,640
I SEP23	99,2	99,235	0,800		98,400	0,765
I DEC23	99,15	99,19	0,850		98,300	0,810
I MAR24	99,125	99,16	0,875		98,250	0,840
I JUN24	99,105	99,14	0,895		98,210	0,860
I SEP24	99,095	99,125	0,905		98,190	0,875
I DEC24	99,085	99,115	0,915		98,170	0,885

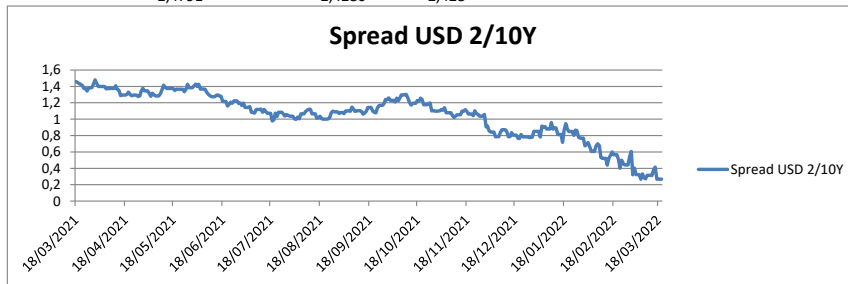
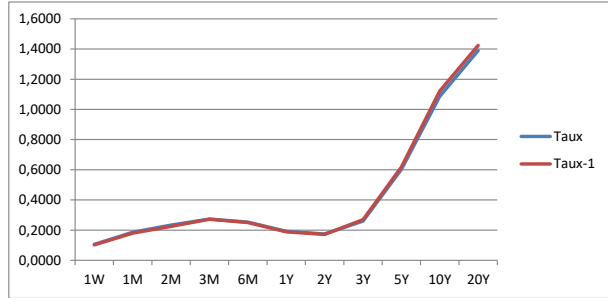


**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	17/03/2022	16/03/2022	Δ
SOFR	0,3000	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

	18/03/2022	17/03/2022	
USA Benchmark 1Y	1,3245	1,3318	1,332
US Benchmark 2Y	1,9527	1,9331	1,933
US Benchmark 3Y	2,1186	2,1396	2,140
US Benchmark 5Y	2,1566	2,1561	2,156
US Benchmark 10Y	2,2313	2,2007	2,201
US Benchmark 20Y	2,5408	2,5585	2,558
US Benchmark 30Y	2,4791	2,4280	2,428



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	17/03/2022	15/03/2022	Δ
SONIA	0,6886	0,4450	0,445
LIBOR 1M GBP Synth	0,7274	0,7856	0,7856
LIBOR 3M/ GBP Synt	0,9699	1,0441	1,0441
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,3911	1,5453	1,5453

	18/03/2022	17/03/2022	
UK Benchmark 1Y	1,2564	1,3600	1,360006
UK Benchmark 2Y	1,2637	1,3793	1,379289
UK Benchmark 3Y	1,3256	1,4348	1,434838
UK Benchmark 4Y	1,1880	1,2613	1,261286
UK Benchmark 5Y	1,2758	1,3600	1,360046
UK Benchmark 6Y	1,2915	1,3673	1,367259
UK Benchmark 7Y	1,3748	1,4432	1,443189
UK Benchmark 8Y	1,3517	1,4231	1,423078
UK Benchmark 9Y	1,5577	1,5846	1,584593
UK Benchmark 10Y	1,5233	1,5829	1,582884
UK Benchmark 12Y	1,6334	1,6896	1,689646
UK Benchmark 15Y	1,6999	1,7434	1,743359
UK Benchmark 20Y	1,7916	1,8284	1,828376

