

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,48%	2,48%	2,51	-0,031
DE Benchmark 10Y	0,59%	0,58%	0,59	-0,003
FR Benchmark 10Y	1,01%	1,00%	1,02	-0,015
FR Benchmark 5Y	0,54%	0,52%	0,57	-0,037
UK Benchmark 10Y	1,70%	1,69%	1,71	-0,016
TEC 10	0,93			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	108,97	113,9
Petrole Brut Baril	115,91	120,65
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,9959	4,1146
Gaz naturel	5,587	5,571
Or 1 Oc	1933,585	1958,205

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0955	1,0952
EUR/JPY	135,49	135,45
EUR/GBP	0,833	0,83283
EUR/CAD	1,36842	1,36797
EUR/CNY	6,9846	6,9765
EUR/BRL	5,1992	5,1927

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	10,43	10,68	9	9,37
3 mois	41,23	41,64	33,05	33,64
6 mois	101,95	103,45	75,47	77,42

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposít EUR ON	-0,75	-0,45
Deposít EUR 1M	-0,9	-0,6
Deposít EUR 2M	-0,9	-0,6
Deposít EUR 3M	-0,9	-0,6
Deposít EUR 6M	-0,62	-0,32
Deposít EUR 12M	-0,38	-0,08

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,581	25/03/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,561	25/03/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,546	25/03/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,477	25/03/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,392	25/03/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,142	25/03/2022

	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 JUN22	100,34	100,345
I SEP22	100,09	100,095
I DEC22	99,74	99,745
I MAR23	99,33	99,335
I JUN23	99,02	99,025

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,598	-0,557
OIS EUR 3M	-0,59	-0,549
OIS EUR 6M	-0,522	-0,481
OIS EUR 1Y	-0,279	-0,238
OIS EUR 2Y	0,263	0,304
OIS EUR 3Y	0,509	0,55

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,437	-0,417
FRA EUR 2x5	-0,385	-0,365
FRA EUR 3x6	-0,325	-0,305
FRA EUR 6x9	-0,069	-0,049
FRA EUR 9x12	0,273	0,293
FRA EUR 3x9	-0,156	-0,136
FRA EUR 6x12	0,183	0,203
FRA EUR 9x15	0,554	0,574
FRA EUR 12x24	1,325	1,345

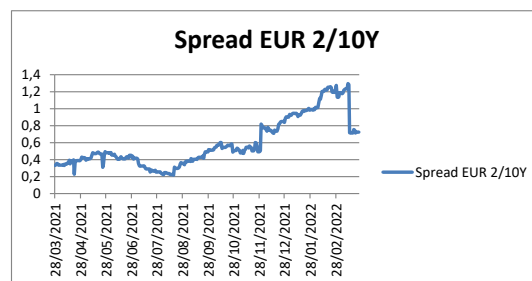
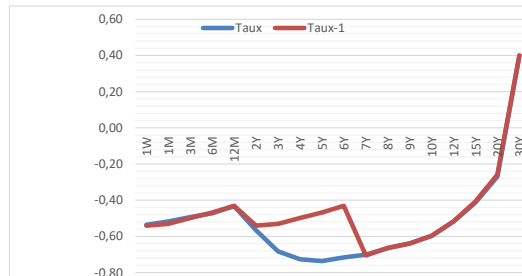
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

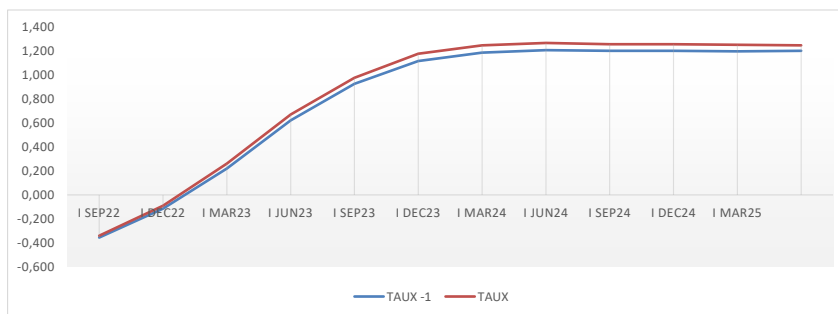
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,166	-0,126
IRS EUR 2Y	0,427	0,467
IRS EUR 3Y	0,694	0,734
IRS EUR 4Y	0,815	0,855
IRS EUR 5Y	0,893	0,933
IRS EUR 6Y	0,941	0,981
IRS EUR 7Y	0,982	1,022
IRS EUR 10Y	1,123	1,163



TAUX EURIBOR	25/03/2022	24/03/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,56	-0,57	0,012
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,54	-0,005
EURIBOR 3M EUR	-0,48	-0,48	0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,39	-0,40	0,005
EURIBOR 12M EUR	-0,14	-0,16	0,018
XEU Benchmark 2Y	-0,12	-0,20	0,075
XEU Benchmark 3Y	0,09	-0,09	0,177
XEU Benchmark 4Y	0,35	0,31	0,049
XEU Benchmark 5Y	0,52	0,47	0,053
XEU Benchmark 6Y	0,38	0,28	0,096
XEU Benchmark 7Y	0,42	0,34	0,085
XEU Benchmark 8Y	0,46	0,38	0,077
XEU Benchmark 9Y	0,51	0,45	0,069
XEU Benchmark 10Y	0,59	0,53	0,065
XEU Benchmark 12Y	1,10	1,08	0,017
XEU Benchmark 15Y	0,69	0,64	0,053
XEU Benchmark 20Y	0,61	0,57	0,038
TEC 30	1,42	1,46	-0,040



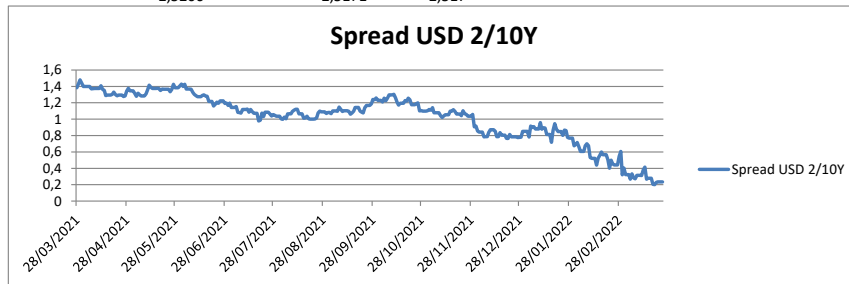
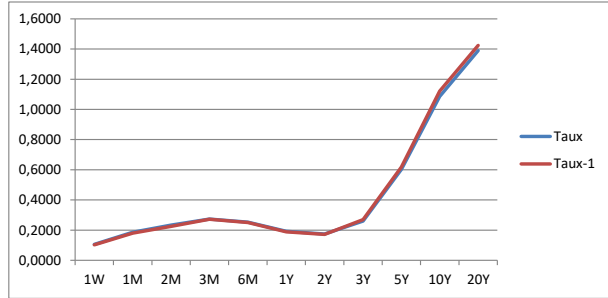
EURIBOR3M	28/03/2022	25/03/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,477					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,34	100,355	-0,340		100,680	-0,355
I SEP22	100,09	100,115	-0,090		100,180	-0,115
I DEC22	99,74	99,78	0,260		99,480	0,220
I MAR23	99,33	99,38	0,670		98,660	0,620
I JUN23	99,025	99,075	0,975		98,050	0,925
I SEP23	98,825	98,885	1,175		97,650	1,115
I DEC23	98,755	98,815	1,245		97,510	1,185
I MAR24	98,735	98,795	1,265		97,470	1,205
I JUN24	98,745	98,8	1,255		97,490	1,200
I SEP24	98,745	98,8	1,255		97,490	1,200
I DEC24	98,75	98,805	1,250		97,500	1,195
I MAR25	98,755	98,8	1,245		97,510	1,200




TAUX US EMPRUNTEUR 

	24/03/2022	23/03/2022	Δ
SOFR	0,2700	0,2700	0,270
SOFR 30 Day	0,1063	0,0990	0,099
SOFR 90 Day	0,0682	0,0658	0,066
SOFR 180 Day	0,0587	0,0575	0,057

	25/03/2022	24/03/2022	
USA Benchmark 1Y	1,5789	1,5310	1,531
US Benchmark 2Y	2,3030	2,1566	2,157
US Benchmark 3Y	2,3659	2,3469	2,347
US Benchmark 5Y	2,5589	2,3887	2,389
US Benchmark 10Y	2,4368	2,3905	2,390
US Benchmark 20Y	2,7631	2,6445	2,644
US Benchmark 30Y	2,5206	2,5171	2,517



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	24/03/2022	23/03/2022	Δ
SONIA	0,6907	0,6908	0,6908
LIBOR 1M GBP Synth	0,7266	0,7265	0,7265
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,0184	1,0071	1,0071
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,4458	1,4510	1,451

	25/03/2022	24/03/2022	
UK Benchmark 1Y	1,2952	1,3035	1,303475
UK Benchmark 2Y	1,4570	1,4210	1,420991
UK Benchmark 3Y	1,5296	1,4875	1,487459
UK Benchmark 4Y	1,4065	1,3723	1,37228
UK Benchmark 5Y	1,5129	1,4581	1,458056
UK Benchmark 6Y	1,5000	1,4635	1,463507
UK Benchmark 7Y	1,5819	1,5426	1,542595
UK Benchmark 8Y	1,5550	1,5068	1,506821
UK Benchmark 9Y	1,5915	1,6060	1,606043
UK Benchmark 10Y	1,7027	1,6727	1,672737
UK Benchmark 12Y	1,8120	1,7712	1,771223
UK Benchmark 15Y	1,8549	1,8186	1,818568
UK Benchmark 20Y	1,9379	1,9101	1,910069

