

Fecha 31/03/2022

Volatilidad	Vertice	EUR.001	EUR.007	EUR.030	EUR.090	EUR.180	EUR.1Y	EUR.2Y	EUR.3Y	EUR.4Y	EUR.5Y	EUR.6Y	EUR.7Y	EUR.8Y	EUR.9Y	EUR.10Y	EUR.20Y	EUR.30Y
0,00003	EUR.001	100,00	99,99	59,57	15,25	5,15	-19,28	-37,88	-39,46	-38,28	-35,74	-34,12	-32,73	-31,39	-29,88	-28,56	-17,93	-10,30
0,00023	EUR.007	99,99	100,00	59,57	15,25	5,15	-19,28	-37,88	-39,46	-38,28	-35,74	-34,12	-32,73	-31,39	-29,88	-28,56	-17,93	-10,30
0,00133	EUR.030	59,57	59,57	100,00	-7,91	33,36	-13,39	-25,06	-28,21	-28,63	-27,99	-27,95	-27,85	-27,48	-26,96	-26,40	-18,94	-12,68
0,00367	EUR.090	15,25	15,25	-7,91	100,00	19,49	20,91	2,02	-0,02	1,61	4,58	6,91	8,41	9,77	10,84	11,88	15,24	15,48
0,00745	EUR.180	5,15	5,15	33,36	19,49	100,00	39,79	27,74	19,60	17,41	16,84	15,85	15,05	14,46	13,86	13,27	11,37	10,35
0,01615	EUR.1Y	-19,28	-19,28	-13,39	20,91	39,79	100,00	71,14	68,41	66,60	64,75	63,64	62,02	60,24	58,01	55,72	42,29	34,45
0,04704	EUR.2Y	-37,88	-37,88	-25,06	2,02	27,74	71,14	100,00	98,94	96,98	93,87	90,54	87,02	83,48	79,78	76,28	55,64	43,59
0,11336	EUR.3Y	-39,46	-39,46	-28,21	-0,02	19,60	68,41	98,94	100,00	99,17	96,83	94,02	90,87	87,59	84,08	80,71	59,89	47,62
0,11949	EUR.4Y	-38,28	-38,28	-28,63	1,61	17,41	66,60	96,98	99,17	100,00	99,18	97,43	95,09	92,46	89,53	86,62	67,35	55,11
0,18499	EUR.5Y	-35,74	-35,74	-27,99	4,58	16,84	64,75	93,87	96,83	99,18	100,00	99,44	98,05	96,18	93,93	91,58	74,27	62,27
0,18833	EUR.6Y	-34,12	-34,12	-27,95	6,91	15,85	63,64	90,54	94,02	97,43	99,44	100,00	99,56	98,48	96,91	95,13	79,78	68,09
0,25429	EUR.7Y	-32,73	-32,73	-27,85	8,41	15,05	62,02	87,02	90,87	95,09	98,05	99,56	100,00	99,66	98,75	97,52	84,17	72,92
0,25724	EUR.8Y	-31,39	-31,39	-27,48	9,77	14,46	60,24	83,48	87,59	92,46	96,18	98,48	99,66	100,00	99,71	98,99	87,73	77,10
0,29321	EUR.9Y	-29,88	-29,88	-26,96	10,84	13,86	58,01	79,78	84,08	89,53	93,93	96,91	98,75	99,71	100,00	99,78	90,61	80,64
0,33075	EUR.10Y	-28,56	-28,56	-26,40	11,88	13,27	55,72	76,28	80,71	86,62	91,58	95,13	97,52	98,99	99,78	100,00	92,87	83,56
0,72825	EUR.20Y	-17,93	-17,93	-18,94	15,24	11,37	42,29	55,64	59,89	67,35	74,27	79,78	84,17	87,73	90,61	92,87	100,00	97,40
1,14915	EUR.30Y	-10,30	-10,30	-12,68	15,48	10,35	34,45	43,59	47,62	55,11	62,27	68,09	72,92	77,10	80,64	83,56	97,40	100,00