

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,57%	2,56%	2,62	-0,053
DE Benchmark 10Y	0,62%	0,61%	0,65	-0,028
FR Benchmark 10Y	1,13%	1,12%	1,18	-0,0515
FR Benchmark 5Y	0,71%	0,70%	0,75	-0,043
UK Benchmark 10Y	1,66%	1,65%	1,71	-0,055
TEC 10	1,05			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	102,74	101,96
Petrole Brut Baril	107,35	106,64
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,5204	3,4682
Gaz naturel	6,113	6,032
Or 1 Oc	1930,385	1923,61

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,091	1,0907
EUR/JPY	135,038	135,032
EUR/GBP	0,83269	0,83264
EUR/CAD	1,36332	1,36297
EUR/CNY	6,944	6,936
EUR/BRL	5,0778	5,0716

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	10,51	10,64	9,39	9,59
3 mois	42,17	42,47	32,83	33,27
6 mois	107,12	108,12	76,07	77,37

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,77	-0,47
Deposît EUR 1M	-0,77	-0,47
Deposît EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposît EUR 3M	-0,75	-0,45
Deposît EUR 6M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 12M	-0,42	-0,12

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,586	05/04/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,578	05/04/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,548	05/04/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,467	05/04/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,375	05/04/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,093	05/04/2022

	31/03/2022	28/02/2022
TMO	1	0,88
TME	0,8	0,68
TMM	-0,4936	-0,4916
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,546	-0,553
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,496	-0,532

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I JUN22	100,34	100,345
I SEP22	100,05	100,055
I DEC22	99,665	99,67
I MAR23	99,205	99,21
I JUN23	98,82	98,825

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,597	-0,556
OIS EUR 3M	-0,586	-0,545
OIS EUR 6M	-0,511	-0,47
OIS EUR 1Y	-0,232	-0,191
OIS EUR 2Y	0,401	0,442
OIS EUR 3Y	0,67	0,711

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,422	-0,402
FRA EUR 2x5	-0,364	-0,344
FRA EUR 3x6	-0,289	-0,269
FRA EUR 6x9	0,012	0,032
FRA EUR 9x12	0,425	0,445
FRA EUR 3x9	-0,105	-0,085
FRA EUR 6x12	0,28	0,3
FRA EUR 9x15	0,727	0,747
FRA EUR 12x24	1,623	1,643

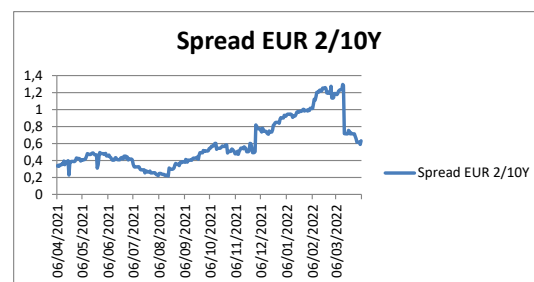
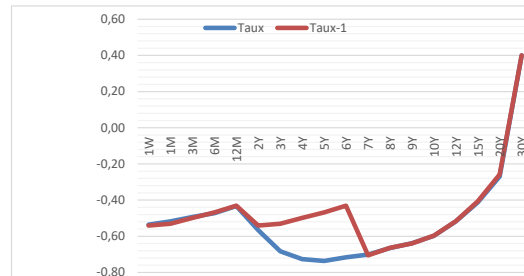
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

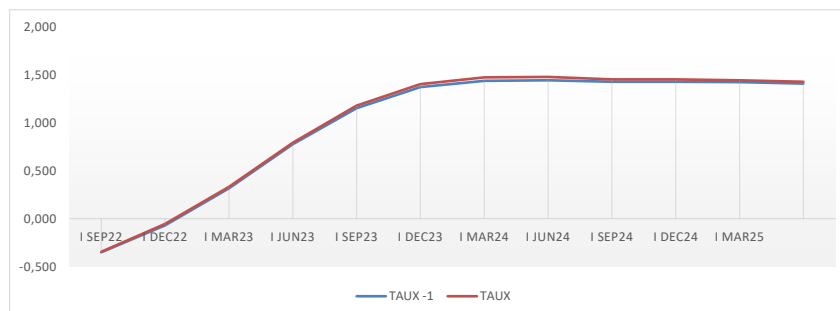
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,092	-0,052
IRS EUR 2Y	0,578	0,618
IRS EUR 3Y	0,86	0,9
IRS EUR 4Y	0,978	1,018
IRS EUR 5Y	1,035	1,075
IRS EUR 6Y	1,083	1,123
IRS EUR 7Y	1,125	1,165
IRS EUR 10Y	1,26	1,3



TAUX EURIBOR	05/04/2022	04/04/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,011
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,55	0,003
EURIBOR 3M EUR	-0,47	-0,45	-0,020
EURIBOR 6M EUR	-0,38	-0,36	-0,017
EURIBOR 12M EUR	-0,09	-0,08	-0,010
XEU Benchmark 2Y	-0,02	-0,08	0,062
XEU Benchmark 3Y	0,19	0,12	0,073
XEU Benchmark 4Y	0,58	0,46	0,119
XEU Benchmark 5Y	0,72	0,59	0,121
XEU Benchmark 6Y	0,46	0,36	0,096
XEU Benchmark 7Y	0,49	0,39	0,100
XEU Benchmark 8Y	0,50	0,40	0,107
XEU Benchmark 9Y	0,55	0,44	0,108
XEU Benchmark 10Y	0,61	0,51	0,106
XEU Benchmark 12Y	1,25	1,11	0,144
XEU Benchmark 15Y	0,72	0,62	0,102
XEU Benchmark 20Y	0,65	0,55	0,100
TEC 30	1,49	1,44	0,050

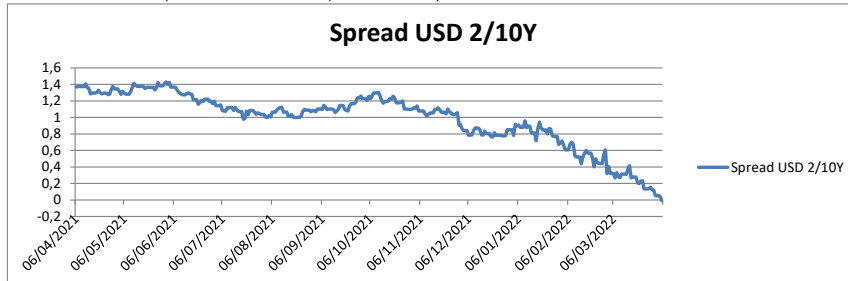
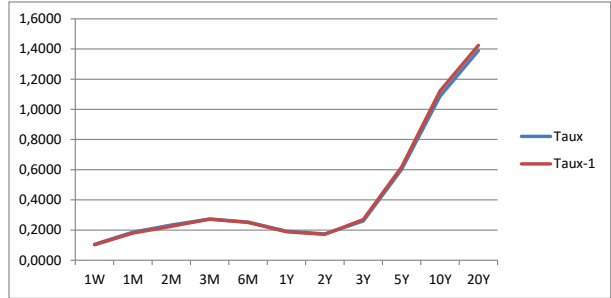


EURIBOR3M	06/04/2022	05/04/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,467					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,345	100,35	-0,345		100,690	-0,350
I SEP22	100,055	100,07	-0,055		100,110	-0,070
I DEC22	99,67	99,685	0,330		99,340	0,315
I MAR23	99,21	99,225	0,790		98,420	0,775
I JUN23	98,825	98,85	1,175		97,650	1,150
I SEP23	98,6	98,63	1,400		97,200	1,370
I DEC23	98,53	98,565	1,470		97,060	1,435
I MAR24	98,525	98,56	1,475		97,050	1,440
I JUN24	98,55	98,575	1,450		97,100	1,425
I SEP24	98,55	98,575	1,450		97,100	1,425
I DEC24	98,56	98,58	1,440		97,120	1,420
I MAR25	98,575	98,595	1,425		97,150	1,405



TAUX US EMPRUNTEUR 

	04/04/2022	01/04/2022	Δ
SOFR	0,3000	0,3000	0,300
SOFR 30 Day	0,1924	0,1673	0,167
SOFR 90 Day	0,0969	0,0886	0,089
SOFR 180 Day	0,0730	0,0688	0,069
05/04/2022			
USA Benchmark 1Y	1,7406	1,6905	1,690
US Benchmark 2Y	2,5047	2,4303	2,430
US Benchmark 3Y	2,6302	2,6588	2,659
US Benchmark 5Y	2,7224	2,5871	2,587
US Benchmark 10Y	2,4976	2,4722	2,472
US Benchmark 20Y	2,7424	2,6301	2,630
US Benchmark 30Y	2,5139	2,4837	2,484



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	04/04/2022	01/04/2022	Δ
SONIA	0,6913	0,6906	0,6906
LIBOR 1M GBP Synth	0,7234	0,7244	0,7244
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,0501	1,0382	1,0382
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,4761	1,4792	1,4792
05/04/2022			
UK Benchmark 1Y	1,4151	1,3104	1,310393
UK Benchmark 2Y	1,5251	1,4483	1,448296
UK Benchmark 3Y	1,5995	1,5082	1,508151
UK Benchmark 4Y	1,5037	1,3851	1,385094
UK Benchmark 5Y	1,5586	1,4737	1,47373
UK Benchmark 6Y	1,4863	1,4157	1,415708
UK Benchmark 7Y	1,5999	1,4874	1,48741
UK Benchmark 8Y	1,5683	1,4706	1,470571
UK Benchmark 9Y	1,5921	1,6067	1,606678
UK Benchmark 10Y	1,6990	1,5868	1,58682
UK Benchmark 12Y	1,7895	1,6840	1,683983
UK Benchmark 15Y	1,8223	1,7182	1,718244
UK Benchmark 20Y	1,8803	1,7943	1,79427

