

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,73%	2,73%	2,78	-0,044
DE Benchmark 10Y	0,79%	0,78%	0,85	-0,055
FR Benchmark 10Y	1,30%	1,29%	1,35	-0,0559
FR Benchmark 5Y	0,80%	0,79%	0,87	-0,068
UK Benchmark 10Y	1,80%	1,80%	1,88	-0,073
TEC 10	1,25			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	100,22	100,6
Petrole Brut Baril	104,29	104,64
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,4678	3,4644
Gaz naturel	6,687	6,68
Or 1 Oc	1970,145	1966,76

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0839	1,0836
EUR/JPY	136,713	136,707
EUR/GBP	0,83406	0,83401
EUR/CAD	1,3703	1,3693
EUR/CNY	6,9018	6,8939
EUR/BRL	5,0688	5,0632

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	11,3	11,41	9,84	10,13
3 mois	44,29	44,55	34,12	34,74
6 mois	106,55	107,55	75,31	77,18

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,77	-0,47
Deposit EUR 1M	-0,76	-0,46
Deposit EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposit EUR 6M	-0,64	-0,34
Deposit EUR 12M	-0,37	-0,07

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,583	12/04/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,573	11/04/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,529	11/04/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,435	11/04/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,334	11/04/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,03	11/04/2022

	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	100,29	100,295
I SEP22	99,99	99,995
I DEC22	99,59	99,595
I MAR23	99,115	99,12
I JUN23	98,675	98,68

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,577	-0,536
OIS EUR 6M	-0,469	-0,428
OIS EUR 1Y	-0,156	-0,115
OIS EUR 2Y	0,526	0,567
OIS EUR 3Y	0,81	0,851

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,368	-0,348
FRA EUR 2x5	-0,29	-0,27
FRA EUR 3x6	-0,2	-0,18
FRA EUR 6x9	0,108	0,128
FRA EUR 9x12	0,562	0,582
FRA EUR 3x9	-0,03	-0,01
FRA EUR 6x12	0,374	0,394
FRA EUR 9x15	0,86	0,88
FRA EUR 12x24	1,864	1,884

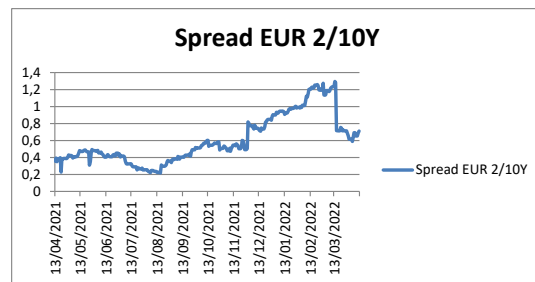
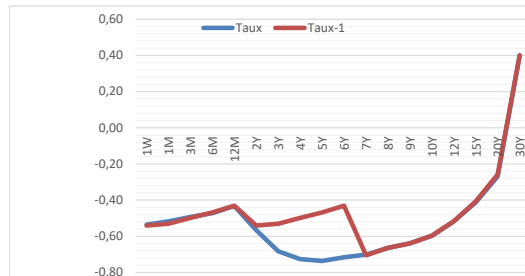
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

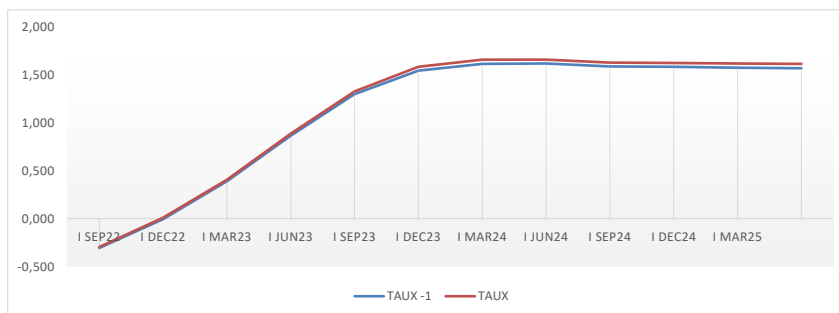
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	-0,005	0,035
IRS EUR 2Y	0,712	0,752
IRS EUR 3Y	1,011	1,051
IRS EUR 4Y	1,147	1,187
IRS EUR 5Y	1,224	1,264
IRS EUR 6Y	1,28	1,32
IRS EUR 7Y	1,335	1,375
IRS EUR 10Y	1,5	1,54



TAUX EURIBOR	11/04/2022	08/04/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,008
EURIBOR 1M EUR	-0,53	-0,54	0,012
EURIBOR 3M EUR	-0,44	-0,45	0,014
EURIBOR 6M EUR	-0,33	-0,35	0,016
EURIBOR 12M EUR	-0,03	-0,05	0,018
	12/04/2022	11/04/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,07	0,12	-0,057
XEU Benchmark 3Y	0,30	0,36	-0,061
XEU Benchmark 4Y	0,66	0,71	-0,050
XEU Benchmark 5Y	0,80	0,85	-0,049
XEU Benchmark 6Y	0,59	0,64	-0,056
XEU Benchmark 7Y	0,63	0,68	-0,049
XEU Benchmark 8Y	0,66	0,70	-0,042
XEU Benchmark 9Y	0,71	0,75	-0,037
XEU Benchmark 10Y	0,78	0,82	-0,035
XEU Benchmark 12Y	1,40	1,40	0,004
XEU Benchmark 15Y	0,90	0,93	-0,024
XEU Benchmark 20Y	0,84	0,86	-0,016
TEC 30	1,63	1,64	-0,010



EURIBOR3M	13/04/2022	12/04/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,435					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,295	100,305	-0,295		100,590	-0,305
I SEP22	99,99	100,005	0,010		99,980	-0,005
I DEC22	99,595	99,61	0,405		99,190	0,390
I MAR23	99,115	99,135	0,885		98,230	0,865
I JUN23	98,675	98,705	1,325		97,350	1,295
I SEP23	98,42	98,46	1,580		96,840	1,540
I DEC23	98,345	98,39	1,655		96,690	1,610
I MAR24	98,345	98,385	1,655		96,690	1,615
I JUN24	98,375	98,415	1,625		96,750	1,585
I SEP24	98,38	98,42	1,620		96,760	1,580
I DEC24	98,385	98,43	1,615		96,770	1,570
I MAR25	98,39	98,435	1,610		96,780	1,565

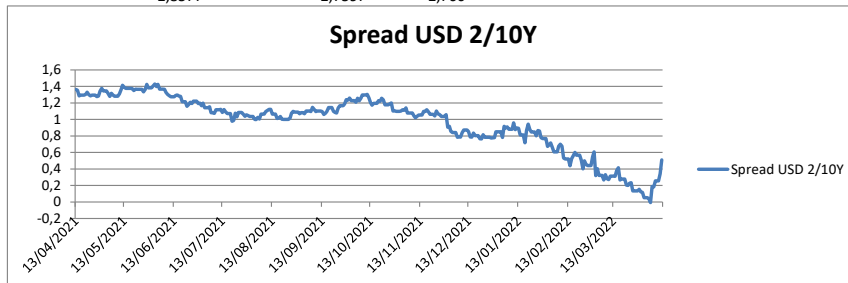
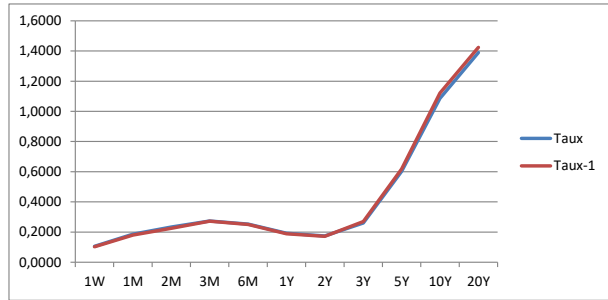



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	11/04/2022	08/04/2022	Δ
SOFR	0,3000	0,3000	0,300
SOFR 30 Day	0,2507	0,2257	0,226
SOFR 90 Day	0,1164	0,1080	0,108
SOFR 180 Day	0,0827	0,0786	0,079

	12/04/2022	11/04/2022	
USA Benchmark 1Y	1,7407	1,7820	1,782
US Benchmark 2Y	2,3865	2,4769	2,477
US Benchmark 3Y	2,7839	2,7940	2,794
US Benchmark 5Y	2,6929	2,8012	2,801
US Benchmark 10Y	2,8963	2,8184	2,818
US Benchmark 20Y	2,9739	2,9894	2,989
US Benchmark 30Y	2,8577	2,7597	2,760



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	08/04/2022	07/04/2022	Δ
SONIA	0,6912	0,6914	0,6914
LIBOR 1M GBP Synth	0,7817	0,7607	0,7607
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,0870	1,0637	1,0637
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,5030	1,4821	1,4821

	12/04/2022	11/04/2022	
UK Benchmark 1Y	1,4341	1,4167	1,416673
UK Benchmark 2Y	1,5903	1,6138	1,613769
UK Benchmark 3Y	1,6448	1,6682	1,66819
UK Benchmark 4Y	1,5419	1,5720	1,571993
UK Benchmark 5Y	1,6253	1,6706	1,670614
UK Benchmark 6Y	1,6122	1,6431	1,643086
UK Benchmark 7Y	1,6886	1,7258	1,725751
UK Benchmark 8Y	1,6743	1,7261	1,72611
UK Benchmark 9Y	1,8707	1,7838	1,783808
UK Benchmark 10Y	1,8430	1,8744	1,874368
UK Benchmark 12Y	1,9365	1,9641	1,9641
UK Benchmark 15Y	1,9887	2,0048	2,004775
UK Benchmark 20Y	2,0388	2,0641	2,064057

