

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,83%	2,82%	2,84	-0,012
DE Benchmark 10Y	0,90%	0,89%	0,88	0,020
FR Benchmark 10Y	1,40%	1,39%	1,38	0,011
FR Benchmark 5Y	0,87%	0,85%	0,86	0,002
UK Benchmark 10Y	1,88%	1,87%	1,84	0,035
TEC 10	1,315			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	105,67	105,36
Petrole Brut Baril	107,9	107,59
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,033	5,1354
Gaz naturel	6,84	6,888
Or 1 Oc	1914,753	1894,65

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0571	1,0567
EUR/JPY	137,56	137,539
EUR/GBP	0,84161	0,84155
EUR/CAD	1,34588	1,34543
EUR/CNY	6,9706	6,9629
EUR/BRL	5,2232	5,2173

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	13,66	13,79	11,94	12,15
3 mois	50,41	50,72	36,78	37,27
6 mois	117,1	117,7	79,93	80,88

MARCHÉ MONETAIRE

MARCHÉ MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposits EUR ON	-0,77	-0,47
Deposits EUR 1M	-0,77	-0,47
Deposits EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposits EUR 3M	-0,74	-0,44
Deposits EUR 6M	-0,6	-0,3
Deposits EUR 12M	-0,26	0,04

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,583	28/04/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,569	27/04/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,52	27/04/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,445	27/04/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,251	27/04/2022
EURIBOR 12M EUR	0,109	27/04/2022

	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	100,245	100,25
I SEP22	99,78	99,785
I DEC22	99,355	99,36
I MAR23	98,915	98,92
I JUN23	98,56	98,565

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,601	-0,56
OIS EUR 3M	-0,568	-0,527
OIS EUR 6M	-0,398	-0,357
OIS EUR 1Y	0,01	0,051
OIS EUR 2Y	0,651	0,692
OIS EUR 3Y	0,882	0,923

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,305	-0,285
FRA EUR 2x5	-0,172	-0,152
FRA EUR 3x6	-0,029	-0,009
FRA EUR 6x9	0,421	0,441
FRA EUR 9x12	0,868	0,888
FRA EUR 3x9	0,218	0,238
FRA EUR 6x12	0,692	0,712
FRA EUR 9x15	1,145	1,165
FRA EUR 12x24	1,73	1,75

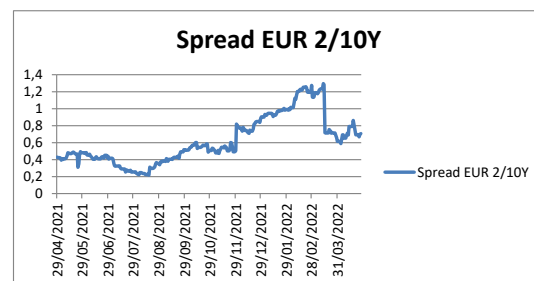
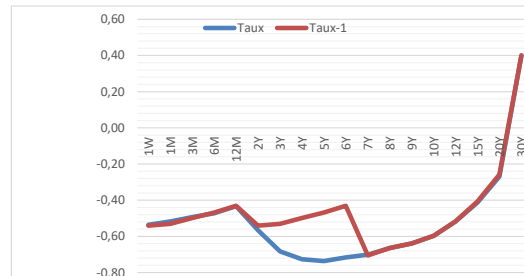
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

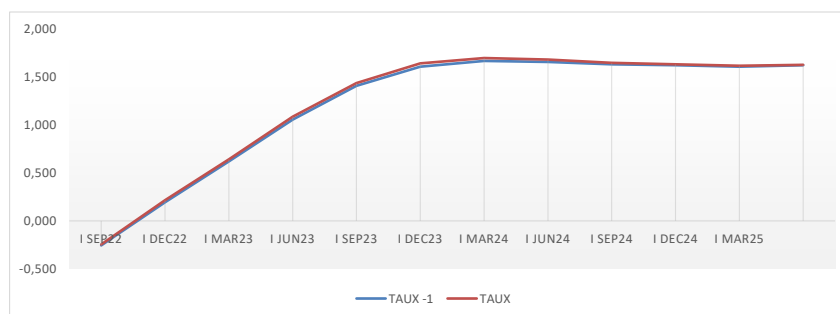
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,191	0,231
IRS EUR 2Y	0,873	0,913
IRS EUR 3Y	1,124	1,164
IRS EUR 4Y	1,244	1,284
IRS EUR 5Y	1,313	1,353
IRS EUR 6Y	1,374	1,414
IRS EUR 7Y	1,433	1,473
IRS EUR 10Y	1,617	1,657



TAUX EURIBOR	27/04/2022	26/04/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,58	0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,52	-0,51	-0,007
EURIBOR 3M EUR	-0,45	-0,43	-0,015
EURIBOR 6M EUR	-0,25	-0,25	-0,005
EURIBOR 12M EUR	0,11	0,11	-0,002
	28/04/2022	27/04/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,19	0,10	0,091
XEU Benchmark 3Y	0,41	0,31	0,100
XEU Benchmark 4Y	0,73	0,63	0,095
XEU Benchmark 5Y	0,86	0,77	0,096
XEU Benchmark 6Y	0,66	0,56	0,096
XEU Benchmark 7Y	0,73	0,63	0,106
XEU Benchmark 8Y	0,77	0,66	0,110
XEU Benchmark 9Y	0,82	0,72	0,101
XEU Benchmark 10Y	0,90	0,80	0,101
XEU Benchmark 12Y	1,54	1,45	0,087
XEU Benchmark 15Y	1,05	0,96	0,094
XEU Benchmark 20Y	0,99	0,90	0,092
TEC 30	1,78	1,76	0,016



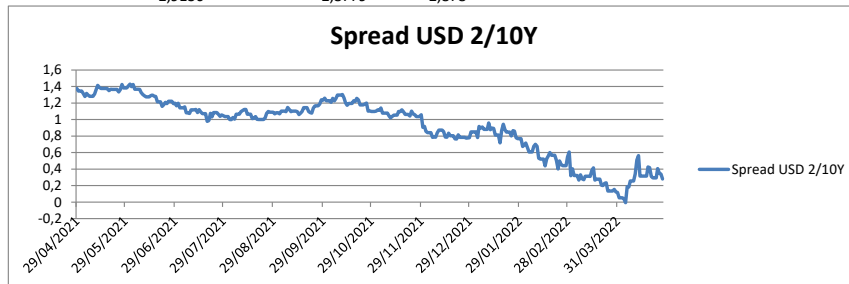
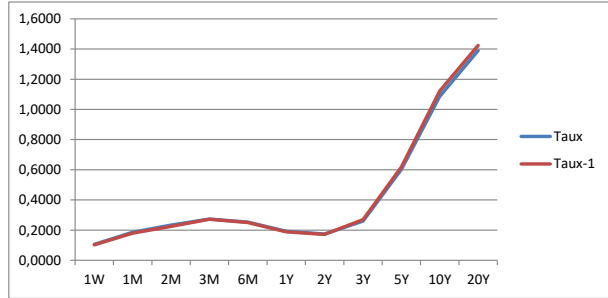
EURIBOR3M	29/04/2022	28/04/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,445					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,245	100,255	-0,245		100,490	-0,255
I SEP22	99,785	99,805	0,215		99,570	0,195
I DEC22	99,36	99,38	0,640		98,720	0,620
I MAR23	98,915	98,945	1,085		97,830	1,055
I JUN23	98,565	98,595	1,435		97,130	1,405
I SEP23	98,36	98,395	1,640		96,720	1,605
I DEC23	98,305	98,335	1,695		96,610	1,665
I MAR24	98,32	98,345	1,680		96,640	1,655
I JUN24	98,355	98,37	1,645		96,710	1,630
I SEP24	98,37	98,38	1,630		96,740	1,620
I DEC24	98,385	98,395	1,615		96,770	1,605
I MAR25	98,375	98,38	1,625		96,750	1,620



TAUX US EMPRUNTEUR 

	27/04/2022	26/04/2022	Δ
SOFR	0,2800	0,2700	0,270
SOFR 30 Day	0,2870	0,2874	0,287
SOFR 90 Day	0,1577	0,1551	0,155
SOFR 180 Day	0,1036	0,1024	0,102

	28/04/2022	27/04/2022	
USA Benchmark 1Y	1,8979	1,8678	1,868
US Benchmark 2Y	2,5890	2,4955	2,495
US Benchmark 3Y	2,7999	2,6769	2,677
US Benchmark 5Y	2,8960	2,8077	2,808
US Benchmark 10Y	2,8692	2,8360	2,836
US Benchmark 20Y	3,1320	3,0846	3,085
US Benchmark 30Y	2,9136	2,8779	2,878



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	26/04/2022	25/04/2022	Δ
SONIA	0,6903	0,6899	0,6899
LIBOR 1M GBP Synth	0,9343	0,9277	0,9277
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,2096	1,2065	1,2065
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,6598	1,6532	1,6532

	28/04/2022	27/04/2022	
UK Benchmark 1Y	1,4955	1,5074	1,507372
UK Benchmark 2Y	1,6054	1,5612	1,561185
UK Benchmark 3Y	1,6722	1,6206	1,620645
UK Benchmark 4Y	1,5868	1,5321	1,532066
UK Benchmark 5Y	1,6956	1,6523	1,652337
UK Benchmark 6Y	1,6746	1,6216	1,621571
UK Benchmark 7Y	1,7652	1,7082	1,708176
UK Benchmark 8Y	1,7530	1,7093	1,709333
UK Benchmark 9Y	1,8092	1,8087	1,808742
UK Benchmark 10Y	1,9126	1,8441	1,844064
UK Benchmark 12Y	2,0009	1,9270	1,926976
UK Benchmark 15Y	2,0540	1,9735	1,973502
UK Benchmark 20Y	2,1113	2,0272	2,027173

