

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,98%	2,98%	3,00	-0,018
DE Benchmark 10Y	0,97%	0,96%	1,00	-0,025
FR Benchmark 10Y	1,49%	1,49%	1,52	-0,0269
FR Benchmark 5Y	0,92%	0,91%	0,97	-0,046
UK Benchmark 10Y	1,91%	1,90%	2,00	-0,096
TEC 10	1,43			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	104,38	105,17
Petrole Brut Baril	106,65	107,58
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,2086	4,2049
Gaz naturel	7,707	7,475
Or 1 Oc	1854,04	1862,3

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0518	1,0514
EUR/JPY	136,906	136,9
EUR/GBP	0,83877	0,83869
EUR/CAD	1,35306	1,35265
EUR/CNY	6,9532	6,9452
EUR/BRL	5,3508	5,3451

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	14,21	14,37	11,42	11,64
3 mois	51,13	51,46	37,37	37,85
6 mois	120,87	121,47	82,59	83,5

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE 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	-0,74	-0,44
Deposît EUR 6M	-0,58	-0,28
Deposît EUR 12M	-0,2	0,1

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,583	02/05/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,566	29/04/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,538	29/04/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,429	29/04/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,226	29/04/2022
EURIBOR 12M EUR	0,166	29/04/2022

	30/04/2022	31/03/2022
TMO	1,51	1
TME	1,31	0,8
TMM	-0,4989	-0,4936
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,538	-0,546
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,447	-0,496

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I JUN22	100,24	100,245
I SEP22	99,745	99,75
I DEC22	99,28	99,285
I MAR23	98,81	98,815
I JUN23	98,45	98,455

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,6	-0,559
OIS EUR 3M	-0,561	-0,52
OIS EUR 6M	-0,379	-0,338
OIS EUR 1Y	0,049	0,09
OIS EUR 2Y	0,722	0,763
OIS EUR 3Y	0,964	1,005

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,293	-0,273
FRA EUR 2x5	-0,153	-0,133
FRA EUR 3x6	0,008	0,028
FRA EUR 6x9	0,494	0,514
FRA EUR 9x12	0,975	0,995
FRA EUR 3x9	0,279	0,299
FRA EUR 6x12	0,777	0,797
FRA EUR 9x15	1,252	1,272
FRA EUR 12x24	1,88	1,9

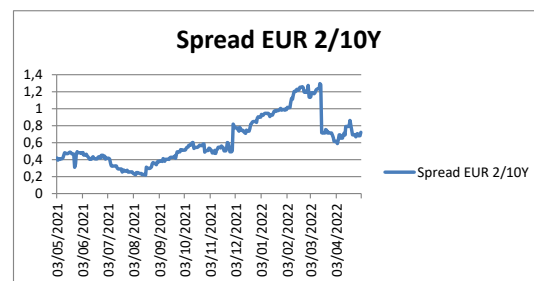
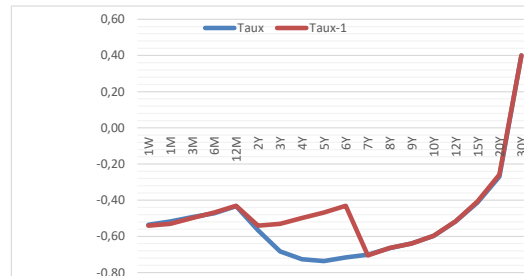
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

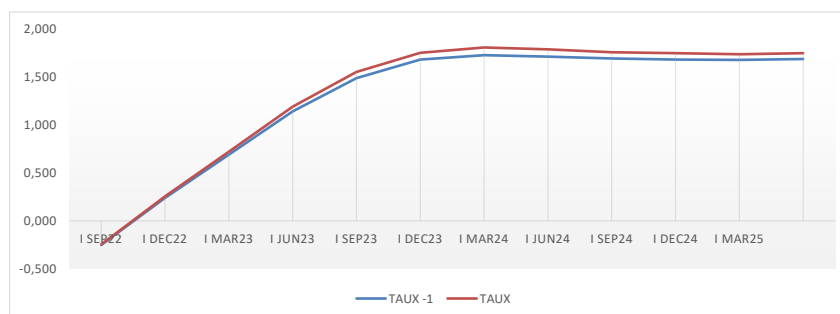
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,246	0,286
IRS EUR 2Y	0,95	0,99
IRS EUR 3Y	1,205	1,245
IRS EUR 4Y	1,335	1,375
IRS EUR 5Y	1,412	1,452
IRS EUR 6Y	1,479	1,519
IRS EUR 7Y	1,543	1,583
IRS EUR 10Y	1,736	1,776



TAUX EURIBOR	29/04/2022	28/04/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,54	-0,52	-0,016
EURIBOR 3M EUR	-0,43	-0,44	0,009
EURIBOR 6M EUR	-0,23	-0,24	0,016
EURIBOR 12M EUR	0,17	0,12	0,048
	02/05/2022	29/04/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,24	0,25	-0,010
XEU Benchmark 3Y	0,45	0,45	-0,002
XEU Benchmark 4Y	0,77	0,76	0,002
XEU Benchmark 5Y	0,91	0,89	0,015
XEU Benchmark 6Y	0,70	0,69	0,010
XEU Benchmark 7Y	0,78	0,77	0,011
XEU Benchmark 8Y	0,83	0,81	0,024
XEU Benchmark 9Y	0,89	0,86	0,030
XEU Benchmark 10Y	0,96	0,93	0,032
XEU Benchmark 12Y	1,75	1,59	0,156
XEU Benchmark 15Y	1,12	1,08	0,042
XEU Benchmark 20Y	1,07	1,02	0,050
TEC 30	1,88	1,84	0,040

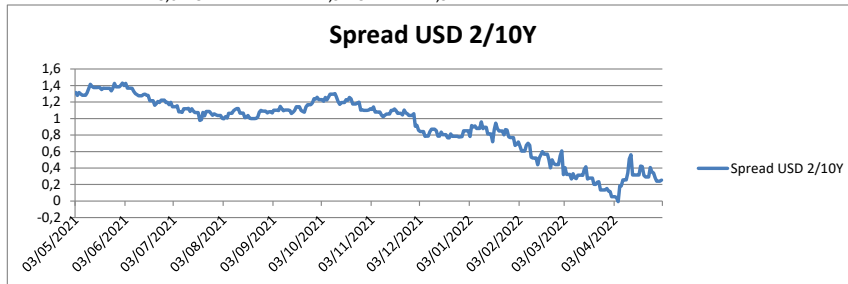
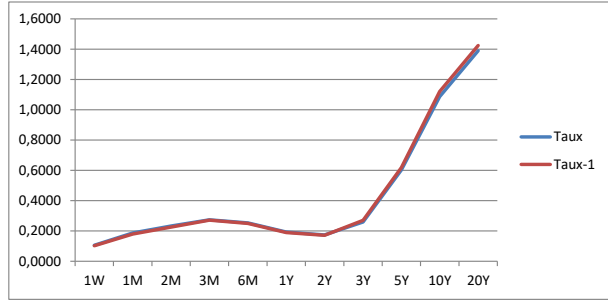


EURIBOR3M	03/05/2022	02/05/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,429					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,245	100,25	-0,245		100,490	-0,250
I SEP22	99,745	99,76	0,255		99,490	0,240
I DEC22	99,28	99,31	0,720		98,560	0,690
I MAR23	98,81	98,86	1,190		97,620	1,140
I JUN23	98,45	98,515	1,550		96,900	1,485
I SEP23	98,25	98,32	1,750		96,500	1,680
I DEC23	98,195	98,275	1,805		96,390	1,725
I MAR24	98,215	98,29	1,785		96,430	1,710
I JUN24	98,245	98,31	1,755		96,490	1,690
I SEP24	98,255	98,32	1,745		96,510	1,680
I DEC24	98,265	98,325	1,735		96,530	1,675
I MAR25	98,255	98,315	1,745		96,510	1,685



TAUX US EMPRUNTEUR 

	02/05/2022	28/04/2022	Δ
SOFR	0,2800	0,2800	0,280
SOFR 30 Day	0,2864	0,2870	0,287
SOFR 90 Day	0,1706	0,1604	0,160
SOFR 180 Day	0,1100	0,1049	0,105
	02/05/2022	29/04/2022	
USA Benchmark 1Y	1,9707	1,9649	1,965
US Benchmark 2Y	2,6801	2,6618	2,662
US Benchmark 3Y	2,9201	2,8547	2,855
US Benchmark 5Y	3,0185	2,9473	2,947
US Benchmark 10Y	2,9347	2,9026	2,903
US Benchmark 20Y	3,2589	3,1394	3,139
US Benchmark 30Y	3,0218	2,9275	2,927



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	28/04/2022	27/04/2022	Δ
SONIA	0,6896	0,6902	0,6902
LIBOR 1M GBP Synth	0,9626	0,9438	0,9438
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,2305	1,2072	1,2072
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,6916	1,6578	1,6578
	02/05/2022	29/04/2022	
UK Benchmark 1Y	1,5475	1,5283	1,528301
UK Benchmark 2Y	1,6342	1,6018	1,601793
UK Benchmark 3Y	1,7216	1,7007	1,700749
UK Benchmark 4Y	1,6322	1,6195	1,619543
UK Benchmark 5Y	1,7411	1,7463	1,746317
UK Benchmark 6Y	1,7053	1,6928	1,692842
UK Benchmark 7Y	1,7930	1,7574	1,757411
UK Benchmark 8Y	1,7866	1,7878	1,787771
UK Benchmark 9Y	1,8979	1,8380	1,837966
UK Benchmark 10Y	1,9325	1,9022	1,902187
UK Benchmark 12Y	2,0251	1,9877	1,987676
UK Benchmark 15Y	2,0731	2,0420	2,041951
UK Benchmark 20Y	2,1343	2,1011	2,101057

