

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,86%	2,86%	2,91	-0,046
DE Benchmark 10Y	0,85%	0,84%	0,92	-0,074
FR Benchmark 10Y	1,38%	1,37%	1,43	-0,0498
FR Benchmark 5Y	0,77%	0,75%	0,81	-0,046
UK Benchmark 10Y	1,67%	1,66%	1,74	-0,073
TEC 10	1,42			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	106,64	106,13
Petrole Brut Baril	108,25	107,45
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,9519	3,9161
Gaz naturel	7,822	7,739
Or 1 Oc	1826,075	1821,8

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,041	1,0408
EUR/JPY	134,122	134,101
EUR/GBP	0,8522	0,8519
EUR/CAD	1,35362	1,35341
EUR/CNY	7,0622	7,0544
EUR/BRL	5,3484	5,342

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	13,58	13,68	11,07	11,23
3 mois	52,71	52,93	36,58	36,96
6 mois	118,73	119,27	76,92	77,81

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposít EUR ON	-0,73	-0,43
Deposít EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposít EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposít EUR 3M	-0,65	-0,35
Deposít EUR 6M	-0,47	-0,17
Deposít EUR 12M	-0,12	0,18

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,577	12/05/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,571	11/05/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,566	11/05/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,414	11/05/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,208	11/05/2022
EURIBOR 12M EUR	0,227	11/05/2022

	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	100,26	100,265
I SEP22	99,82	99,825
I DEC22	99,45	99,455
I MAR23	99,1	99,105
I JUN23	98,8	98,805

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,6	-0,559
OIS EUR 3M	-0,529	-0,488
OIS EUR 6M	-0,342	-0,301
OIS EUR 1Y	0,012	0,053
OIS EUR 2Y	0,528	0,569
OIS EUR 3Y	0,743	0,784

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,233	-0,213
FRA EUR 2x5	-0,144	-0,124
FRA EUR 3x6	-0,051	-0,031
FRA EUR 6x9	0,392	0,412
FRA EUR 9x12	0,834	0,854
FRA EUR 3x9	0,211	0,231
FRA EUR 6x12	0,632	0,652
FRA EUR 9x15	1,057	1,077
FRA EUR 12x24	1,455	1,475

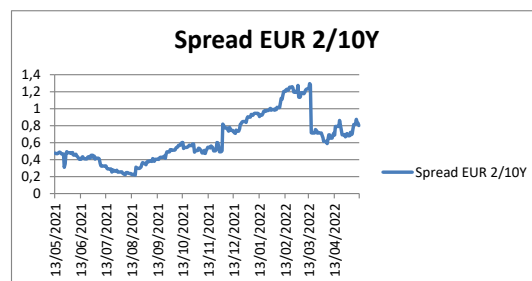
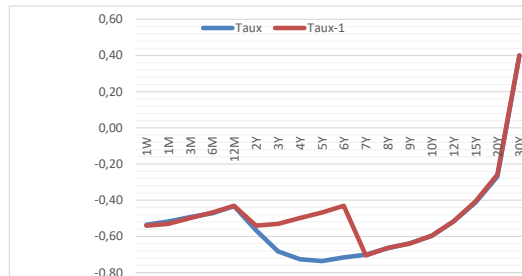
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

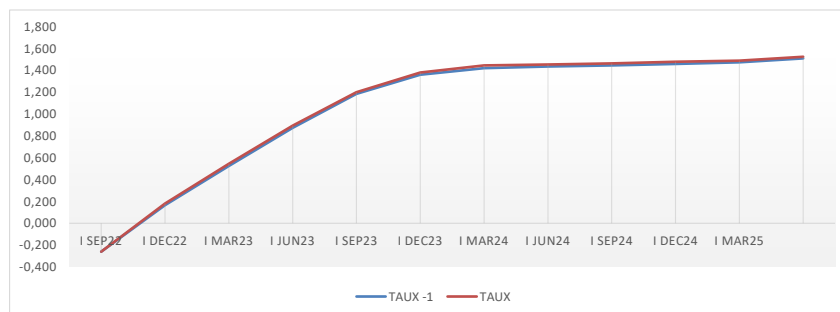
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,177	0,217
IRS EUR 2Y	0,742	0,782
IRS EUR 3Y	0,979	1,019
IRS EUR 4Y	1,132	1,172
IRS EUR 5Y	1,233	1,273
IRS EUR 6Y	1,323	1,363
IRS EUR 7Y	1,408	1,448
IRS EUR 10Y	1,64	1,68



TAUX EURIBOR	11/05/2022	10/05/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,56	-0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,57	-0,55	-0,013
EURIBOR 3M EUR	-0,41	-0,42	0,003
EURIBOR 6M EUR	-0,21	-0,20	-0,006
EURIBOR 12M EUR	0,23	0,24	-0,009
	12/05/2022	11/05/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,06	0,13	-0,071
XEU Benchmark 3Y	0,28	0,36	-0,083
XEU Benchmark 4Y	0,60	0,72	-0,122
XEU Benchmark 5Y	0,76	0,89	-0,133
XEU Benchmark 6Y	0,57	0,67	-0,108
XEU Benchmark 7Y	0,66	0,76	-0,107
XEU Benchmark 8Y	0,71	0,82	-0,106
XEU Benchmark 9Y	0,78	0,88	-0,106
XEU Benchmark 10Y	0,86	0,96	-0,099
XEU Benchmark 12Y	1,64	1,76	-0,113
XEU Benchmark 15Y	1,02	1,12	-0,092
XEU Benchmark 20Y	0,98	1,06	-0,079
TEC 30	1,85	1,92	-0,070

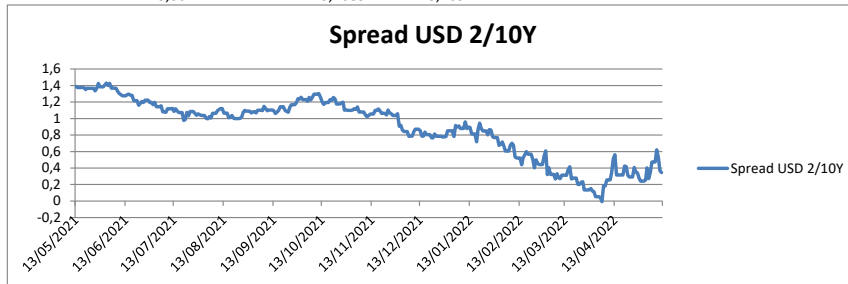
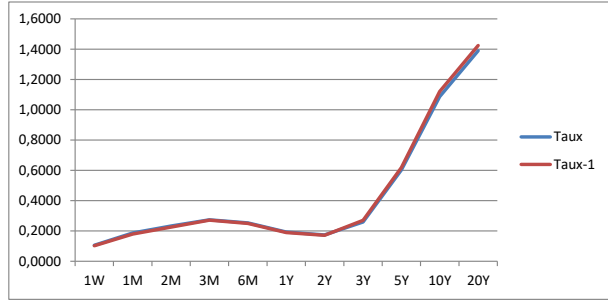


EURIBOR3M	13/05/2022	12/05/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,414					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,26	100,26	-0,260		100,520	-0,260
I SEP22	99,82	99,835	0,180		99,640	0,165
I DEC22	99,455	99,475	0,545		98,910	0,525
I MAR23	99,105	99,125	0,895		98,210	0,875
I JUN23	98,8	98,815	1,200		97,600	1,185
I SEP23	98,62	98,64	1,380		97,240	1,360
I DEC23	98,555	98,58	1,445		97,110	1,420
I MAR24	98,545	98,565	1,455		97,090	1,435
I JUN24	98,535	98,555	1,465		97,070	1,445
I SEP24	98,52	98,54	1,480		97,040	1,460
I DEC24	98,51	98,525	1,490		97,020	1,475
I MAR25	98,475	98,49	1,525		96,950	1,510



TAUX US EMPRUNTEUR 

	12/05/2022	10/05/2022	Δ
SOFR	0,7800	0,7800	0,780
SOFR 30 Day	0,3987	0,3667	0,367
SOFR 90 Day	0,2360	0,2196	0,220
SOFR 180 Day	0,1427	0,1345	0,135
12/05/2022 11/05/2022			
USA Benchmark 1Y	1,8929	1,9506	1,951
US Benchmark 2Y	2,5539	2,6508	2,651
US Benchmark 3Y	2,7598	2,8010	2,801
US Benchmark 5Y	2,8638	2,9688	2,969
US Benchmark 10Y	2,8975	3,0168	3,017
US Benchmark 20Y	3,2285	3,3330	3,333
US Benchmark 30Y	3,0041	3,1089	3,109



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	10/05/2022	09/05/2022	Δ
SONIA	0,9397	0,9403	0,9403
LIBOR 1M GBP Synth	0,9736	0,9737	0,9737
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,2412	1,2372	1,2372
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,6479	1,6536	1,6536
12/05/2022 11/05/2022			
UK Benchmark 1Y	1,4701	1,4255	1,42554
UK Benchmark 2Y	1,2676	1,3992	1,399214
UK Benchmark 3Y	1,3343	1,4688	1,468819
UK Benchmark 4Y	1,2741	1,4231	1,423137
UK Benchmark 5Y	1,4202	1,5381	1,538084
UK Benchmark 6Y	1,3950	1,5736	1,573578
UK Benchmark 7Y	1,5266	1,7084	1,708445
UK Benchmark 8Y	1,5177	1,6747	1,674731
UK Benchmark 9Y	1,7374	1,8282	1,828201
UK Benchmark 10Y	1,7176	1,9028	1,90275
UK Benchmark 12Y	1,8545	2,0343	2,034266
UK Benchmark 15Y	1,9294	2,1043	2,104279
UK Benchmark 20Y	2,0124	2,2031	2,203108

