

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,76%	2,75%	2,76	0,001
DE Benchmark 10Y	0,97%	0,96%	0,95	0,018
FR Benchmark 10Y	1,48%	1,48%	1,48	0,0077
FR Benchmark 5Y	0,93%	0,91%	0,92	0,007
UK Benchmark 10Y	1,89%	1,88%	1,89	-0,006
TEC 10	1,51			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	111,05	109,77
Petrole Brut Baril	114,86	113,56
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,805	3,7818
Gaz naturel	8,827	8,796
Or 1 Oc	1857,65	1866,5

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,06836	1,06825
EUR/JPY	135,846	135,83
EUR/GBP	0,85226	0,85195
EUR/CAD	1,37097	1,37079
EUR/CNY	7,12974	7,12201
EUR/BRL	5,1519	5,14607

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	15,26	15,38	11,54	11,77
3 mois	55,81	56,11	37,87	38,52
6 mois	117,23	117,83	75,46	76,38

MARCHÉ MONETAIRE

MARCHÉ MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 3M	-0,6	-0,3
Deposit EUR 6M	-0,36	-0,06
Deposit EUR 12M	0,13	0,43

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,587	24/05/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,568	23/05/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,543	23/05/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,363	23/05/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,085	23/05/2022
EURIBOR 12M EUR	0,348	23/05/2022

	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	100,235	100,24
I SEP22	99,64	99,645
I DEC22	99,25	99,255
I MAR23	98,915	98,92
I JUN23	98,685	98,69

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,472	-0,431
OIS EUR 6M	-0,215	-0,174
OIS EUR 1Y	0,202	0,243
OIS EUR 2Y	0,673	0,714
OIS EUR 3Y	0,851	0,892

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,177	-0,157
FRA EUR 2x5	0,018	0,038
FRA EUR 3x6	0,222	0,242
FRA EUR 6x9	0,643	0,663
FRA EUR 9x12	0,997	1,017
FRA EUR 3x9	0,434	0,454
FRA EUR 6x12	0,841	0,861
FRA EUR 9x15	1,165	1,185
FRA EUR 12x24	1,603	1,623

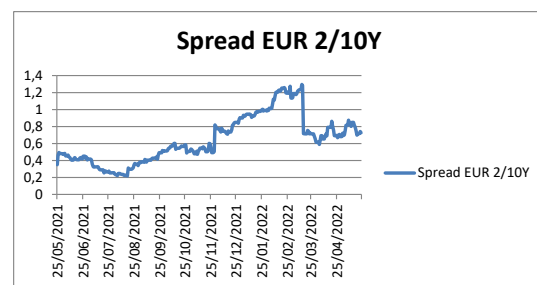
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

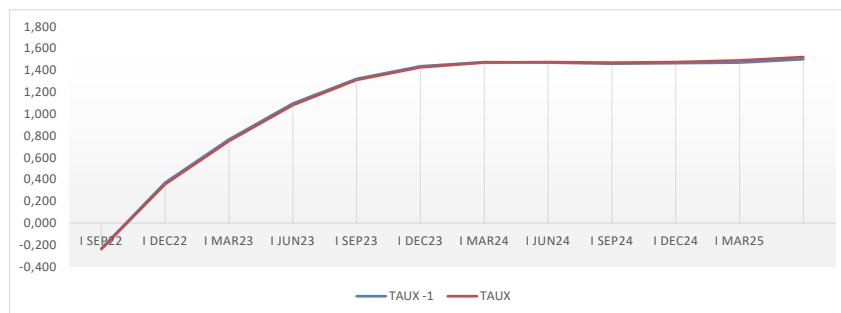
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,365	0,405
IRS EUR 2Y	0,869	0,909
IRS EUR 3Y	1,063	1,103
IRS EUR 4Y	1,187	1,227
IRS EUR 5Y	1,278	1,318
IRS EUR 6Y	1,352	1,392
IRS EUR 7Y	1,42	1,46
IRS EUR 10Y	1,618	1,658



	23/05/2022	20/05/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	-0,002
EURIBOR 1M EUR	-0,54	-0,54	-0,008
EURIBOR 3M EUR	-0,36	-0,35	-0,015
EURIBOR 6M EUR	-0,09	-0,08	-0,007
EURIBOR 12M EUR	0,35	0,35	-0,005
	24/05/2022	23/05/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,23	0,28	-0,044
XEU Benchmark 3Y	0,43	0,48	-0,049
XEU Benchmark 4Y	0,77	0,83	-0,055
XEU Benchmark 5Y	0,91	0,97	-0,055
XEU Benchmark 6Y	0,71	0,76	-0,057
XEU Benchmark 7Y	0,78	0,84	-0,058
XEU Benchmark 8Y	0,82	0,88	-0,060
XEU Benchmark 9Y	0,87	0,93	-0,059
XEU Benchmark 10Y	0,96	1,02	-0,058
XEU Benchmark 12Y	1,63	1,68	-0,048
XEU Benchmark 15Y	1,14	1,19	-0,050
XEU Benchmark 20Y	1,11	1,15	-0,042
TEC 30	2,00	1,95	0,050

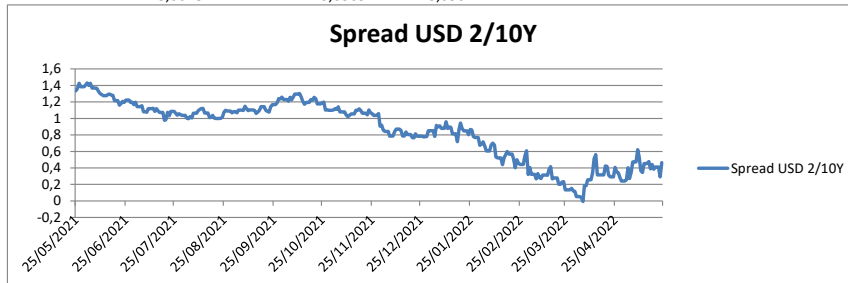
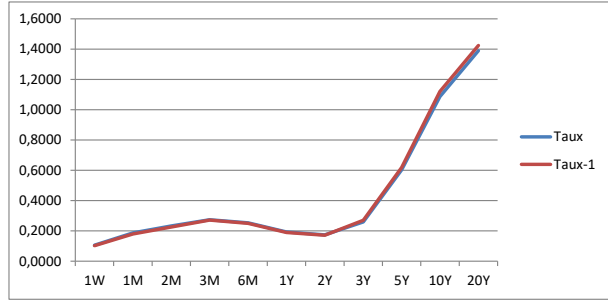


EURIBOR3M	25/05/2022	24/05/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,363					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,24	100,235	-0,240		100,480	-0,235
I SEP22	99,645	99,63	0,355		99,290	0,370
I DEC22	99,25	99,235	0,750		98,500	0,765
I MAR23	98,92	98,905	1,080		97,840	1,095
I JUN23	98,69	98,68	1,310		97,380	1,320
I SEP23	98,575	98,565	1,425		97,150	1,435
I DEC23	98,53	98,525	1,470		97,060	1,475
I MAR24	98,525	98,53	1,475		97,050	1,470
I JUN24	98,53	98,54	1,470		97,060	1,460
I SEP24	98,525	98,535	1,475		97,050	1,465
I DEC24	98,51	98,53	1,490		97,020	1,470
I MAR25	98,48	98,5	1,520		96,960	1,500



TAUX US EMPRUNTEUR 

	24/05/2022	20/05/2022	Δ
SOFR	0,7800	0,7800	0,780
SOFR 30 Day	0,6015	0,5331	0,533
SOFR 90 Day	0,3345	0,3020	0,302
SOFR 180 Day	0,1919	0,1757	0,176
USA Benchmark 1Y			
	1,8484	1,8820	1,882
US Benchmark 2Y	2,4102	2,5418	2,542
US Benchmark 3Y	2,7007	2,7658	2,766
US Benchmark 5Y	2,7423	2,8745	2,874
US Benchmark 10Y	2,8753	2,8327	2,833
US Benchmark 20Y	3,1710	3,2512	3,251
US Benchmark 30Y	3,0628	3,0565	3,056



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	20/05/2022	19/05/2022	Δ
SONIA	0,9389	0,9392	0,9392
LIBOR 1M GBP Synth	1,0476	1,0146	1,0146
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,3763	1,3557	1,3557
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,8353	1,8103	1,8103
UK Benchmark 1Y			
	1,5258	1,5954	1,595383
UK Benchmark 2Y	1,4847	1,6188	1,618845
UK Benchmark 3Y	1,5693	1,7021	1,702111
UK Benchmark 4Y	1,4737	1,6037	1,603673
UK Benchmark 5Y	1,6049	1,7431	1,743076
UK Benchmark 6Y	1,6009	1,7099	1,709852
UK Benchmark 7Y	1,7273	1,8346	1,834576
UK Benchmark 8Y	1,6885	1,8088	1,808808
UK Benchmark 9Y	1,8854	1,8940	1,89398
UK Benchmark 10Y	1,9024	2,0048	2,004763
UK Benchmark 12Y	2,0200	2,1165	2,116518
UK Benchmark 15Y	2,0927	2,1800	2,179994
UK Benchmark 20Y	2,1764	2,2580	2,257985

