

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,75%	2,75%	2,75	-0,003
DE Benchmark 10Y	1,00%	0,99%	0,99	0,007
FR Benchmark 10Y	1,51%	1,50%	1,51	0,0037
FR Benchmark 5Y	0,91%	0,90%	0,92	-0,004
UK Benchmark 10Y	1,97%	1,96%	1,97	0,007
TEC 10	1,43			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	113,7	114,09
Petrole Brut Baril	117,1	117,4
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,9363	3,968
Gaz naturel	8,813	8,908
Or 1 Oc	1857,8	1850,58

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0751	1,0748
EUR/JPY	136,68	136,654
EUR/GBP	0,85121	0,85115
EUR/CAD	1,37073	1,37057
EUR/CNY	7,2412	7,23364
EUR/BRL	5,13032	5,12485

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	15,4	15,48	11,44	11,58
3 mois	55,23	55,44	37,18	37,53
6 mois	116,46	117	75,63	76,55

MARCHÉ MONETAIRE

MARCHÉ MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,73	-0,43
Deposît EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposît EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposît EUR 3M	-0,6	-0,3
Deposît EUR 6M	-0,34	-0,04
Deposît EUR 12M	0,14	0,44

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,59	26/05/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,575	25/05/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,547	25/05/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,351	25/05/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,062	25/05/2022
EURIBOR 12M EUR	0,359	25/05/2022

	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	100,25	100,255
I SEP22	99,665	99,67
I DEC22	99,26	99,265
I MAR23	98,92	98,925
I JUN23	98,69	98,695

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,597	-0,556
OIS EUR 3M	-0,474	-0,433
OIS EUR 6M	-0,213	-0,172
OIS EUR 1Y	0,213	0,254
OIS EUR 2Y	0,692	0,733
OIS EUR 3Y	0,874	0,915

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,166	-0,146
FRA EUR 2x5	0,019	0,039
FRA EUR 3x6	0,222	0,242
FRA EUR 6x9	0,647	0,667
FRA EUR 9x12	1,008	1,028
FRA EUR 3x9	0,444	0,464
FRA EUR 6x12	0,868	0,888
FRA EUR 9x15	1,178	1,198
FRA EUR 12x24	1,632	1,652

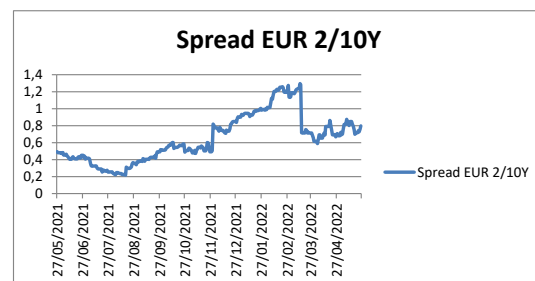
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

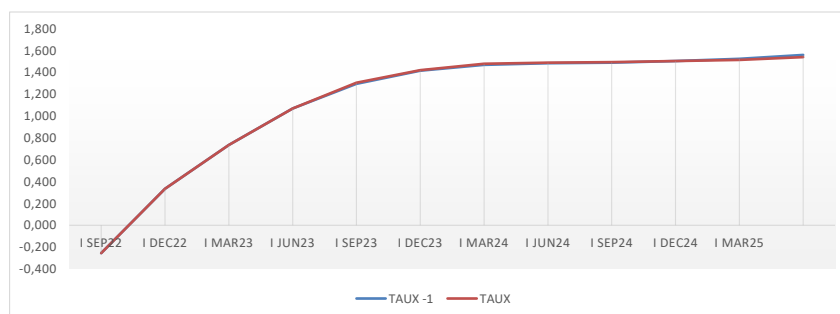
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,374	0,414
IRS EUR 2Y	0,886	0,926
IRS EUR 3Y	1,085	1,125
IRS EUR 4Y	1,218	1,258
IRS EUR 5Y	1,323	1,363
IRS EUR 6Y	1,405	1,445
IRS EUR 7Y	1,481	1,521
IRS EUR 10Y	1,701	1,741



	25/05/2022	24/05/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,58	-0,57	-0,002
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,54	-0,004
EURIBOR 3M EUR	-0,35	-0,36	0,005
EURIBOR 6M EUR	-0,06	-0,07	0,011
EURIBOR 12M EUR	0,36	0,36	-0,005
	26/05/2022	25/05/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,21	0,21	0,000
XEU Benchmark 3Y	0,42	0,41	0,007
XEU Benchmark 4Y	0,76	0,75	0,012
XEU Benchmark 5Y	0,91	0,89	0,020
XEU Benchmark 6Y	0,72	0,70	0,025
XEU Benchmark 7Y	0,80	0,77	0,031
XEU Benchmark 8Y	0,85	0,82	0,033
XEU Benchmark 9Y	0,92	0,88	0,043
XEU Benchmark 10Y	1,01	0,97	0,041
XEU Benchmark 12Y	1,68	1,64	0,040
XEU Benchmark 15Y	1,20	1,15	0,053
XEU Benchmark 20Y	1,22	1,15	0,069
TEC 30	1,99	1,98	0,010



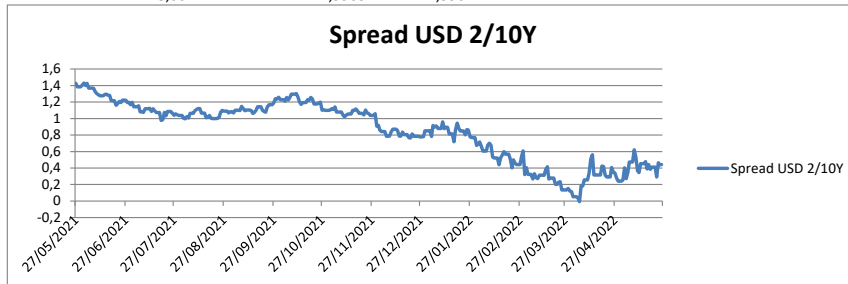
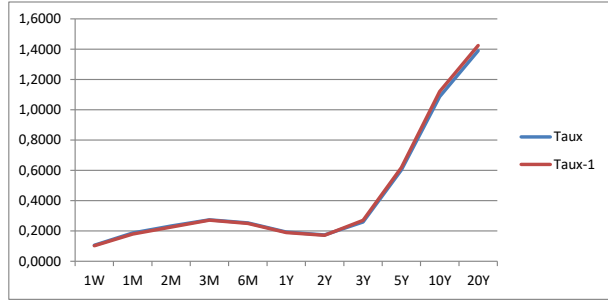
EURIBOR3M	27/05/2022	26/05/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,351					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,255	100,255	-0,255		100,510	-0,255
I SEP22	99,665	99,665	0,335		99,330	0,335
I DEC22	99,265	99,265	0,735		98,530	0,735
I MAR23	98,93	98,93	1,070		97,860	1,070
I JUN23	98,695	98,705	1,305		97,390	1,295
I SEP23	98,58	98,585	1,420		97,160	1,415
I DEC23	98,52	98,53	1,480		97,040	1,470
I MAR24	98,51	98,515	1,490		97,020	1,485
I JUN24	98,505	98,51	1,495		97,010	1,490
I SEP24	98,495	98,495	1,505		96,990	1,505
I DEC24	98,485	98,475	1,515		96,970	1,525
I MAR25	98,46	98,44	1,540		96,920	1,560



TAUX US EMPRUNTEUR 

	26/05/2022	24/05/2022	Δ
SOFR	0,7800	0,7800	0,780
SOFR 30 Day	0,6355	0,6015	0,601
SOFR 90 Day	0,3507	0,3345	0,334
SOFR 180 Day	0,2000	0,1919	0,192

	26/05/2022	25/05/2022	
USA Benchmark 1Y	1,8205	1,8278	1,828
US Benchmark 2Y	2,3480	2,3706	2,371
US Benchmark 3Y	2,6056	2,6629	2,663
US Benchmark 5Y	2,7512	2,7374	2,737
US Benchmark 10Y	2,7891	2,8106	2,811
US Benchmark 20Y	3,2268	3,1843	3,184
US Benchmark 30Y	3,0014	2,9963	2,996



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	24/05/2022	23/05/2022	Δ
SONIA	0,9391	0,9393	0,9393
LIBOR 1M GBP Synth	1,0680	1,0460	1,046
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,3470	1,3391	1,3391
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,7804	1,7688	1,7688

	26/05/2022	25/05/2022	
UK Benchmark 1Y	1,4879	1,5165	1,516458
UK Benchmark 2Y	1,4851	1,5102	1,51023
UK Benchmark 3Y	1,5810	1,5971	1,59711
UK Benchmark 4Y	1,5187	1,4951	1,495099
UK Benchmark 5Y	1,6537	1,6134	1,613361
UK Benchmark 6Y	1,6795	1,6658	1,665808
UK Benchmark 7Y	1,8010	1,7541	1,754078
UK Benchmark 8Y	1,7765	1,7150	1,71496
UK Benchmark 9Y	1,8737	1,8960	1,895967
UK Benchmark 10Y	1,9924	1,9574	1,957419
UK Benchmark 12Y	2,1205	2,0765	2,076492
UK Benchmark 15Y	2,1982	2,1497	2,149668
UK Benchmark 20Y	2,2839	2,2365	2,236533

