

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,76%	2,75%	2,81	-0,051
DE Benchmark 10Y	1,06%	1,05%	1,04	0,021
FR Benchmark 10Y	1,56%	1,55%	1,55	0,0106
FR Benchmark 5Y	0,99%	0,98%	0,98	0,018
UK Benchmark 10Y	1,99%	1,98%	1,97	0,017
TEC 10	1,56			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	118,79	115,07
Petrole Brut Baril	123,46	121,67
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,0711	3,9715
Gaz naturel	8,73	8,727
Or 1 Oc	1854,96	1856,57

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0738	1,0735
EUR/JPY	137,119	137,113
EUR/GBP	0,85158	0,85153
EUR/CAD	1,36128	1,36108
EUR/CNY	7,15806	7,15029
EUR/BRL	5,10718	5,1009

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	17,95	18,04	11,98	12,14
3 mois	55,16	55,37	38,24	38,64
6 mois	115,68	116,22	76,05	77,08

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE 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	-0,59	-0,29
Deposît EUR 6M	-0,32	-0,02
Deposît EUR 12M	0,18	0,48

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,586	30/05/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,572	27/05/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,545	27/05/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,368	27/05/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,076	27/05/2022
EURIBOR 12M EUR	0,358	27/05/2022

	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	100,255	100,26
I SEP22	99,63	99,635
I DEC22	99,2	99,205
I MAR23	98,835	98,84
I JUN23	98,575	98,58

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,596	-0,555
OIS EUR 3M	-0,461	-0,42
OIS EUR 6M	-0,185	-0,144
OIS EUR 1Y	0,268	0,309
OIS EUR 2Y	0,787	0,828
OIS EUR 3Y	0,968	1,009

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,149	-0,129
FRA EUR 2x5	0,044	0,064
FRA EUR 3x6	0,255	0,275
FRA EUR 6x9	0,707	0,727
FRA EUR 9x12	1,096	1,116
FRA EUR 3x9	0,484	0,504
FRA EUR 6x12	0,924	0,944
FRA EUR 9x15	1,267	1,287
FRA EUR 12x24	1,791	1,811

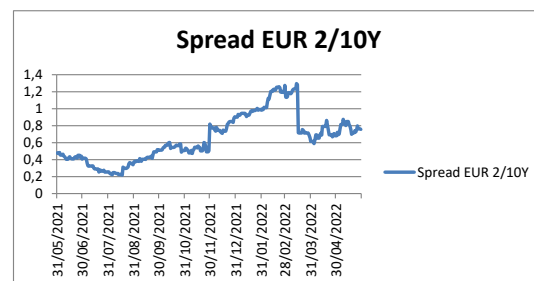
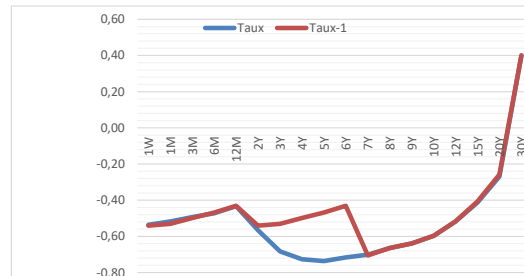
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

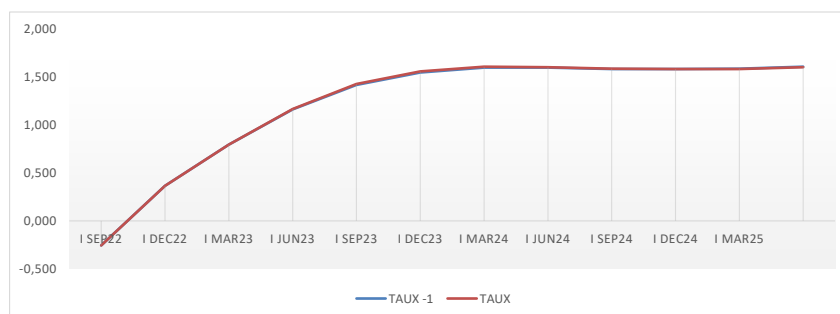
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,419	0,459
IRS EUR 2Y	0,97	1,01
IRS EUR 3Y	1,163	1,203
IRS EUR 4Y	1,277	1,317
IRS EUR 5Y	1,361	1,401
IRS EUR 6Y	1,436	1,476
IRS EUR 7Y	1,505	1,545
IRS EUR 10Y	1,712	1,752



TAUX EURIBOR	27/05/2022	26/05/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,56	-0,009
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,54	-0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,37	-0,35	-0,016
EURIBOR 6M EUR	-0,08	-0,06	-0,015
EURIBOR 12M EUR	0,36	0,36	-0,002
	30/05/2022	27/05/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,30	0,21	0,091
XEU Benchmark 3Y	0,53	0,41	0,115
XEU Benchmark 4Y	0,84	0,74	0,096
XEU Benchmark 5Y	0,99	0,89	0,102
XEU Benchmark 6Y	0,81	0,70	0,100
XEU Benchmark 7Y	0,88	0,78	0,095
XEU Benchmark 8Y	0,92	0,83	0,089
XEU Benchmark 9Y	0,97	0,89	0,085
XEU Benchmark 10Y	1,06	0,98	0,083
XEU Benchmark 12Y	1,72	1,64	0,081
XEU Benchmark 15Y	1,25	1,18	0,076
XEU Benchmark 20Y	1,26	1,20	0,066
TEC 30	2,11	2,06	0,050

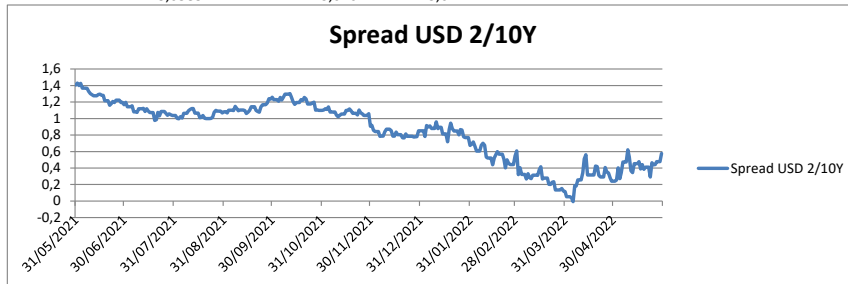
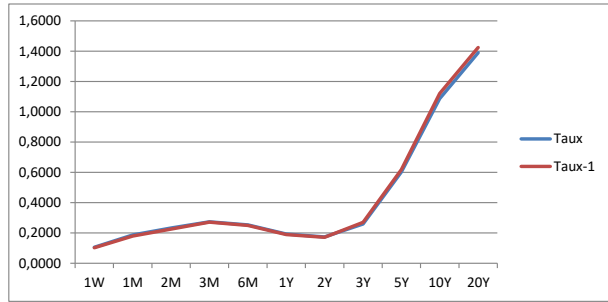


EURIBOR3M	31/05/2022	30/05/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,368					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,255	100,255	-0,255		100,510	-0,255
I SEP22	99,635	99,635	0,365		99,270	0,365
I DEC22	99,205	99,205	0,795		98,410	0,795
I MAR23	98,835	98,84	1,165		97,670	1,160
I JUN23	98,575	98,585	1,425		97,150	1,415
I SEP23	98,445	98,455	1,555		96,890	1,545
I DEC23	98,395	98,405	1,605		96,790	1,595
I MAR24	98,4	98,405	1,600		96,800	1,595
I JUN24	98,415	98,42	1,585		96,830	1,580
I SEP24	98,42	98,42	1,580		96,840	1,580
I DEC24	98,42	98,415	1,580		96,840	1,585
I MAR25	98,4	98,395	1,600		96,800	1,605



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	27/05/2022	25/05/2022	Δ
SOFR	0,7800	0,7800	0,780
SOFR 30 Day	0,6525	0,6185	0,618
SOFR 90 Day	0,3588	0,3426	0,343
SOFR 180 Day	0,2041	0,1960	0,196
<b>30/05/2022</b> / <b>27/05/2022</b>			
USA Benchmark 1Y	1,8722	1,8400	1,840
US Benchmark 2Y	2,3482	2,3399	2,340
US Benchmark 3Y	2,6374	2,6340	2,634
US Benchmark 5Y	2,7419	2,7392	2,739
US Benchmark 10Y	2,9260	2,8184	2,818
US Benchmark 20Y	3,1878	3,1668	3,167
US Benchmark 30Y	3,0585	3,0207	3,021



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	26/05/2022	25/05/2022	Δ
SONIA	0,9388	0,9384	0,9384
LIBOR 1M GBP Synth	1,0782	1,0699	1,0699
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,3844	1,3500	1,35
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,8231	1,7838	1,7838
<b>30/05/2022</b> / <b>27/05/2022</b>			
UK Benchmark 1Y	1,5858	1,5182	1,518157
UK Benchmark 2Y	1,5397	1,4749	1,474896
UK Benchmark 3Y	1,6274	1,5586	1,558636
UK Benchmark 4Y	1,5342	1,5069	1,506893
UK Benchmark 5Y	1,6565	1,6163	1,616346
UK Benchmark 6Y	1,6830	1,6351	1,635118
UK Benchmark 7Y	1,8140	1,7645	1,764467
UK Benchmark 8Y	1,7862	1,7270	1,726966
UK Benchmark 9Y	1,9676	1,9316	1,931649
UK Benchmark 10Y	2,0223	1,9556	1,955551
UK Benchmark 12Y	2,1468	2,0800	2,079986
UK Benchmark 15Y	2,2201	2,1470	2,14701
UK Benchmark 20Y	2,3164	2,2188	2,218767

