

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,93%	2,93%	2,92	0,011
DE Benchmark 10Y	1,19%	1,18%	1,21	-0,022
FR Benchmark 10Y	1,70%	1,69%	1,73	-0,0332
FR Benchmark 5Y	1,13%	1,12%	1,17	-0,038
UK Benchmark 10Y	2,16%	2,15%	2,16	0,000
TEC 10	1,64			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	112,61	115,26
Petrole Brut Baril	113,58	116,29
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,0578	4,1433
Gaz naturel	8,748	8,696
Or 1 Oc	1851,805	1846,5

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0688	1,0685
EUR/JPY	138,857	138,849
EUR/GBP	0,8529	0,85254
EUR/CAD	1,35265	1,35248
EUR/CNY	7,1371	7,12937
EUR/BRL	5,15034	5,14455

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	16,55	16,64	11,9	12,09
3 mois	55,47	55,68	38,02	38,49
6 mois	116,23	116,77	75,65	76,86

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposit EUR 2M	-0,68	-0,38
Deposit EUR 3M	-0,57	-0,27
Deposit EUR 6M	-0,32	-0,02
Deposit EUR 12M	0,24	0,54

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,582	01/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,568	31/05/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,546	31/05/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,338	31/05/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,045	31/05/2022
EURIBOR 12M EUR	0,39	31/05/2022

	31/05/2022	30/04/2022
TMO	1,76	1,51
TME	1,56	1,31
TMM	-0,5001	-0,4989
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,545	-0,538
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,387	-0,447

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I JUN22	100,25	100,255
I SEP22	99,575	99,58
I DEC22	99,095	99,1
I MAR23	98,685	98,69
I JUN23	98,39	98,395

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,444	-0,403
OIS EUR 6M	-0,139	-0,098
OIS EUR 1Y	0,36	0,401
OIS EUR 2Y	0,944	0,985
OIS EUR 3Y	1,144	1,185

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,111	-0,091
FRA EUR 2x5	0,119	0,139
FRA EUR 3x6	0,329	0,349
FRA EUR 6x9	0,825	0,845
FRA EUR 9x12	1,256	1,276
FRA EUR 3x9	0,576	0,596
FRA EUR 6x12	1,064	1,084
FRA EUR 9x15	1,442	1,462
FRA EUR 12x24	2,105	2,125

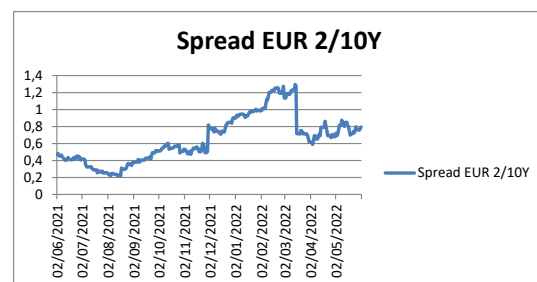
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

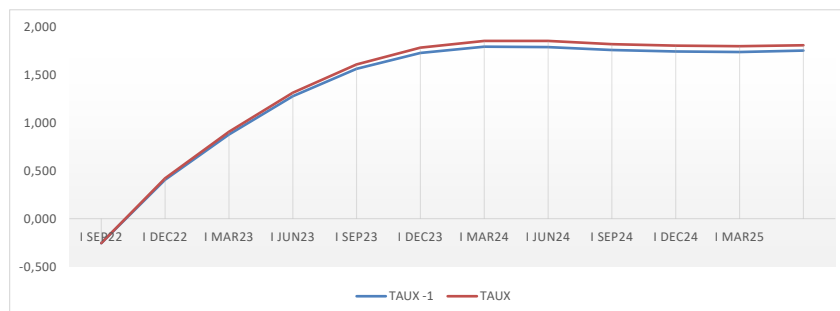
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,513	0,553
IRS EUR 2Y	1,131	1,171
IRS EUR 3Y	1,344	1,384
IRS EUR 4Y	1,462	1,502
IRS EUR 5Y	1,548	1,588
IRS EUR 6Y	1,621	1,661
IRS EUR 7Y	1,687	1,727
IRS EUR 10Y	1,887	1,927



	31/05/2022	30/05/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,001
EURIBOR 1M EUR	-0,55	-0,55	-0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,34	-0,35	0,016
EURIBOR 6M EUR	-0,05	-0,07	0,023
EURIBOR 12M EUR	0,39	0,36	0,029
	01/06/2022	31/05/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,39	0,34	0,051
XEU Benchmark 3Y	0,63	0,57	0,058
XEU Benchmark 4Y	0,97	0,92	0,054
XEU Benchmark 5Y	1,12	1,06	0,064
XEU Benchmark 6Y	0,93	0,86	0,071
XEU Benchmark 7Y	1,00	0,93	0,071
XEU Benchmark 8Y	1,05	0,98	0,072
XEU Benchmark 9Y	1,11	1,03	0,074
XEU Benchmark 10Y	1,19	1,12	0,071
XEU Benchmark 12Y	1,86	1,79	0,073
XEU Benchmark 15Y	1,39	1,31	0,082
XEU Benchmark 20Y	1,40	1,32	0,085
TEC 30	2,19	2,14	0,050

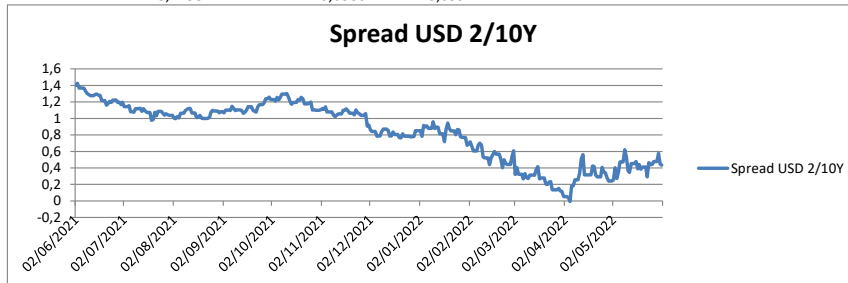
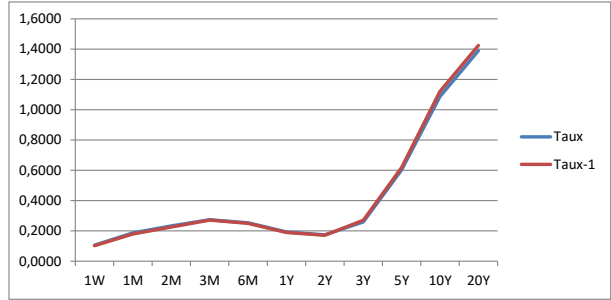


EURIBOR3M	02/06/2022	01/06/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,338					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,255	100,255	-0,255		100,510	-0,255
I SEP22	99,58	99,595	0,420		99,160	0,405
I DEC22	99,095	99,125	0,905		98,190	0,875
I MAR23	98,69	98,725	1,310		97,380	1,275
I JUN23	98,395	98,44	1,605		96,790	1,560
I SEP23	98,22	98,275	1,780		96,440	1,725
I DEC23	98,15	98,21	1,850		96,300	1,790
I MAR24	98,15	98,215	1,850		96,300	1,785
I JUN24	98,185	98,245	1,815		96,370	1,755
I SEP24	98,2	98,26	1,800		96,400	1,740
I DEC24	98,205	98,265	1,795		96,410	1,735
I MAR25	98,195	98,25	1,805		96,390	1,750



TAUX US EMPRUNTEUR 

	01/06/2022	27/05/2022	Δ
SOFR	0,7900	0,7800	0,780
SOFR 30 Day	0,7362	0,6525	0,653
SOFR 90 Day	0,3995	0,3588	0,359
SOFR 180 Day	0,2245	0,2041	0,204
01/06/2022 / 31/05/2022			
USA Benchmark 1Y	1,9809	1,8922	1,892
US Benchmark 2Y	2,5215	2,4313	2,431
US Benchmark 3Y	2,7614	2,6542	2,654
US Benchmark 5Y	2,9594	2,8538	2,854
US Benchmark 10Y	2,9544	2,8787	2,879
US Benchmark 20Y	3,3230	3,3183	3,318
US Benchmark 30Y	3,1258	3,0586	3,059



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	30/05/2022	27/05/2022	Δ
SONIA	0,9384	0,9383	0,9383
LIBOR 1M GBP Synth	1,1226	1,1125	1,1125
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,4247	1,4090	1,409
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,8710	1,8604	1,8604
01/06/2022 / 31/05/2022			
UK Benchmark 1Y	1,6139	1,5765	1,57651
UK Benchmark 2Y	1,6883	1,6552	1,655202
UK Benchmark 3Y	1,8372	1,7443	1,744332
UK Benchmark 4Y	1,6862	1,6086	1,608565
UK Benchmark 5Y	1,8087	1,7402	1,740198
UK Benchmark 6Y	1,8326	1,7904	1,790386
UK Benchmark 7Y	1,9661	1,9096	1,909594
UK Benchmark 8Y	1,9326	1,8947	1,894701
UK Benchmark 9Y	2,1074	1,9576	1,957578
UK Benchmark 10Y	2,1697	2,1449	2,144931
UK Benchmark 12Y	2,3024	2,2800	2,280042
UK Benchmark 15Y	2,3672	2,3703	2,370336
UK Benchmark 20Y	2,4633	2,4658	2,465831

