

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
	3,16%	3,16%	3,22	-0,057
DE Benchmark 10Y	1,52%	1,51%	1,54	-0,019
FR Benchmark 10Y	2,10%	2,09%	2,16	-0,0609
FR Benchmark 5Y	1,60%	1,59%	1,66	-0,055
UK Benchmark 10Y	2,45%	2,44%	2,47	-0,023
	1,96			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
	118,5	120,67
Petrole Brut Baril	119,87	122,01
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,3103	4,3667
Gaz naturel	8,59	8,85
Or 1 Oc	1859,7525	1871,4

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
	1,0483	1,0479
EUR/JPY	141,189	141,181
EUR/GBP	0,85539	0,85532
EUR/CAD	1,34467	1,34448
EUR/CNY	7,06106	7,05323
EUR/BRL	5,23134	5,22556

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois		18,05		13,38
3 mois	59,19	59,51	41,33	42,01
6 mois	124,47	125,28	82	83,58

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
	-0,73	-0,43
Deposits EUR 1M	-0,7	-0,4
Deposits EUR 2M	-0,61	-0,31
Deposits EUR 3M	-0,52	-0,22
Deposits EUR 6M	-0,21	0,09
Deposits EUR 12M	0,34	0,64

FIXING	TAUX	DATE
	-0,581	10/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,568	10/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,539	10/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,298	10/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,083	10/06/2022
EURIBOR 12M EUR	0,68	10/06/2022

	21 En cours...	31 En cours...
	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	
	100,285	100,29
I SEP22	99,39	99,395
I DEC22	98,62	98,625
I MAR23	98,045	98,05
I JUN23	97,765	97,77

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
	-0,583	-0,542
OIS EUR 3M	-0,427	-0,386
OIS EUR 6M	-0,014	0,027
OIS EUR 1Y	0,727	0,768
OIS EUR 2Y	1,427	1,468
OIS EUR 3Y	1,613	1,654

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
	-0,015	0,005
FRA EUR 2x5	0,264	0,284
FRA EUR 3x6	0,57	0,59
FRA EUR 6x9	1,34	1,36
FRA EUR 9x12	1,95	1,97
FRA EUR 3x9	0,935	0,955
FRA EUR 6x12	1,658	1,678
FRA EUR 9x15	2,121	2,141
FRA EUR 12x24	3,077	3,097

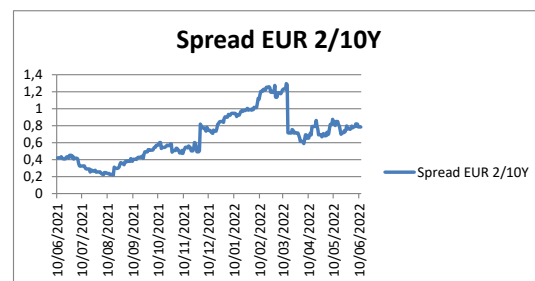
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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 2Y	0,891	0,931
IRS EUR 3Y	1,619	1,659
IRS EUR 4Y	1,819	1,859
IRS EUR 5Y	1,921	1,961
IRS EUR 6Y	1,987	2,027
IRS EUR 7Y	2,03	2,07
IRS EUR 10Y	2,064	2,104
IRS EUR 10Y	2,206	2,246

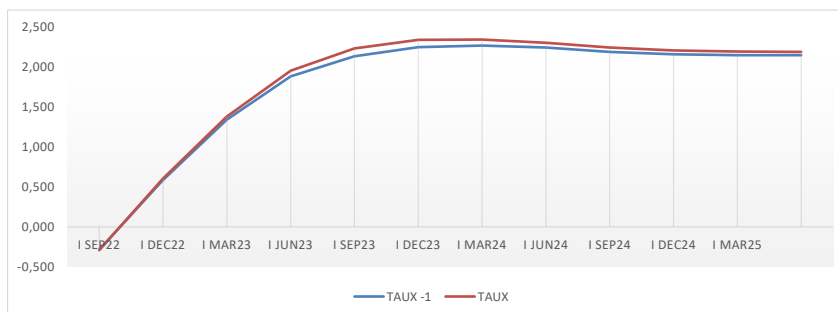


TAUX EURIBOR	28 En cours...	33 En cours...	Δ
EURIBOR 1M EUR	-0,57	-0,58	0,010
EURIBOR 3M EUR	-0,54	-0,53	-0,006
EURIBOR 6M EUR	-0,30	-0,28	-0,016
EURIBOR 12M EUR	0,08	0,06	0,020
	0,68	0,61	0,066
	23 En cours...	27 En cours...	
XEU Benchmark 3Y	0,77	0,65	0,122
XEU Benchmark 4Y	1,06	0,94	0,122
XEU Benchmark 5Y	1,42	1,28	0,142
XEU Benchmark 6Y	1,59	1,44	0,149
XEU Benchmark 7Y	1,33	1,22	0,113
XEU Benchmark 8Y	1,38	1,28	0,099
XEU Benchmark 9Y	1,40	1,31	0,088
XEU Benchmark 10Y	1,44	1,36	0,077
XEU Benchmark 12Y	1,51	1,44	0,070
XEU Benchmark 15Y	2,19	2,09	0,097
XEU Benchmark 20Y	1,63	1,59	0,038
TEC 30	1,63	1,60	0,028
	2,37	2,37	0,000



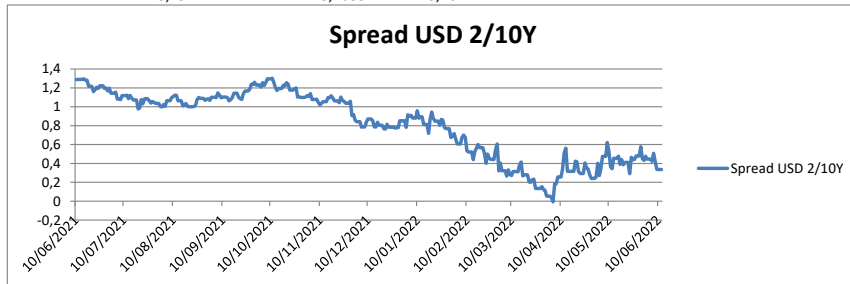
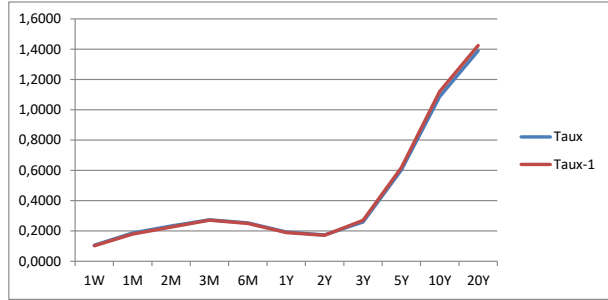
EURIBOR3M

LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	24 En cours...	19 En cours...	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
	100,29	100,285	-0,290		100,580	-0,285	0,008
I SEP22	99,395	99,415	0,605		98,790	0,585	0,903
I DEC22	98,62	98,66	1,380		97,240	1,340	1,678
I MAR23	98,05	98,12	1,950		96,100	1,880	2,248
I JUN23	97,77	97,87	2,230		95,540	2,130	2,528
I SEP23	97,665	97,755	2,335		95,330	2,245	2,633
I DEC23	97,66	97,735	2,340		95,320	2,265	2,638
I MAR24	97,7	97,76	2,300		95,400	2,240	2,598
I JUN24	97,76	97,815	2,240		95,520	2,185	2,538
I SEP24	97,795	97,845	2,205		95,590	2,155	2,503
I DEC24	97,81	97,855	2,190		95,620	2,145	2,488
I MAR25	97,815	97,855	2,185		95,630	2,145	2,483



TAUX US EMPRUNTEUR

	34 En cours...	25 En cours...	Δ
		0,7500	0,7600
SOFR 30 Day		0,7829	0,7846
SOFR 90 Day		0,4723	0,4566
SOFR 180 Day		0,2608	0,2530
	20 En cours...	22 En cours...	
		2,2284	2,1497
US Benchmark 2Y		2,9015	2,7520
US Benchmark 3Y		2,9962	2,9388
US Benchmark 5Y		3,2438	3,1083
US Benchmark 10Y		3,1028	3,0873
US Benchmark 20Y		3,4907	3,4484
US Benchmark 30Y		3,1917	3,2035



TAUX UK EMPRUNTEUR

	30 En cours...	32 En cours...	Δ
		0,9407	0,9402
LIBOR 1M GBP Synth		1,2400	1,2197
LIBOR 3M/ GBP Synt		1,5377	1,5025
LIBOR 6M/ GBP Synt		2,0624	1,9974
	26 En cours...	35 En cours...	
		1,7854	1,7454
UK Benchmark 2Y		2,0806	1,9673
UK Benchmark 3Y		2,2567	2,0784
UK Benchmark 4Y		2,0893	1,9192
UK Benchmark 5Y		2,2286	2,0504
UK Benchmark 6Y		2,1532	2,0344
UK Benchmark 7Y		2,2900	2,1684
UK Benchmark 8Y		2,2625	2,1298
UK Benchmark 9Y		2,3014	2,2248
UK Benchmark 10Y		2,4482	2,3776
UK Benchmark 12Y		2,5752	2,5011
UK Benchmark 15Y		2,5928	2,5472
UK Benchmark 20Y		2,6201	2,5903

