

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,23%	3,23%	3,24	-0,008
DE Benchmark 10Y	1,72%	1,71%	1,70	0,016
FR Benchmark 10Y	2,26%	2,25%	2,26	0,0008
FR Benchmark 5Y	1,81%	1,79%	1,81	0,001
UK Benchmark 10Y	2,52%	2,51%	2,48	0,039
TEC 10	2,35			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	118,22	117,59
Petrole Brut Baril	120,41	119,81
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,5802	4,5713
Gaz naturel	7,417	7,464
Or 1 Oc	1848,815	1857,5

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0527	1,05254
EUR/JPY	141,23	141,184
EUR/GBP	0,85574	0,85569
EUR/CAD	1,3664	1,3624
EUR/CNY	7,05584	7,04809
EUR/BRL	5,3229	5,31678

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	19,86	20,05	12,4	12,69
3 mois	65,96	66,38	40,11	40,81
6 mois	138,38	139,66	82,59	84,53

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,73	-0,43
Deposit EUR 2M	-0,58	-0,28
Deposit EUR 3M	-0,5	-0,2
Deposit EUR 6M	0,04	0,34
Deposit EUR 12M	0,82	1,12

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,582	16/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,566	15/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,494	15/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,182	15/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,237	15/06/2022
EURIBOR 12M EUR	1,067	15/06/2022

	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		
I SEP22	99,205	99,21
I DEC22	98,44	98,445
I MAR23	97,92	97,925
I JUN23	97,66	97,67

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,341	-0,3
OIS EUR 6M	0,117	0,158
OIS EUR 1Y	0,867	0,908
OIS EUR 2Y	1,537	1,578
OIS EUR 3Y	1,744	1,785

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,15	0,17
FRA EUR 2x5	0,469	0,489
FRA EUR 3x6	0,789	0,809
FRA EUR 6x9	1,554	1,574
FRA EUR 9x12	2,087	2,107
FRA EUR 3x9	1,163	1,183
FRA EUR 6x12	1,806	1,826
FRA EUR 9x15	2,237	2,257
FRA EUR 12x24	2,794	2,814

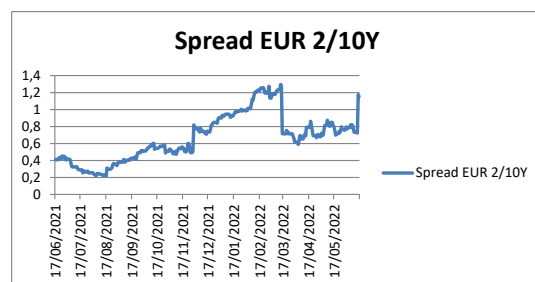
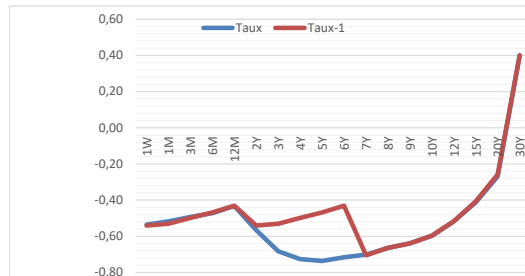
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

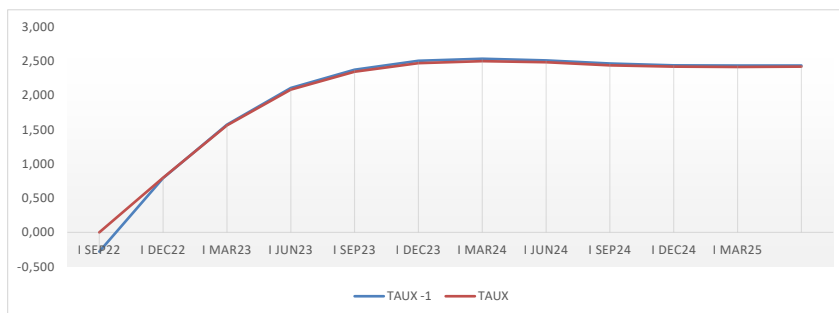
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,071	1,111
IRS EUR 2Y	1,759	1,799
IRS EUR 3Y	1,969	2,009
IRS EUR 4Y	2,089	2,129
IRS EUR 5Y	2,175	2,215
IRS EUR 6Y	2,223	2,263
IRS EUR 7Y	2,273	2,313
IRS EUR 10Y	2,44	2,48



TAUX EURIBOR	15/06/2022	14/06/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,49	-0,51	0,018
EURIBOR 3M EUR	-0,18	-0,24	0,061
EURIBOR 6M EUR	0,24	0,18	0,062
EURIBOR 12M EUR	1,07	0,96	0,110
	16/06/2022	15/06/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,07	0,98	0,089
XEU Benchmark 3Y	1,29	1,18	0,105
XEU Benchmark 4Y	1,68	1,60	0,083
XEU Benchmark 5Y	1,80	1,72	0,081
XEU Benchmark 6Y	1,58	1,49	0,090
XEU Benchmark 7Y	1,59	1,50	0,086
XEU Benchmark 8Y	1,63	1,54	0,087
XEU Benchmark 9Y	2,07	2,01	0,061
XEU Benchmark 10Y	2,22	2,15	0,062
XEU Benchmark 12Y	2,38	2,35	0,028
XEU Benchmark 15Y	1,87	1,80	0,071
XEU Benchmark 20Y	1,85	1,78	0,062
TEC 30	2,72	2,69	0,030

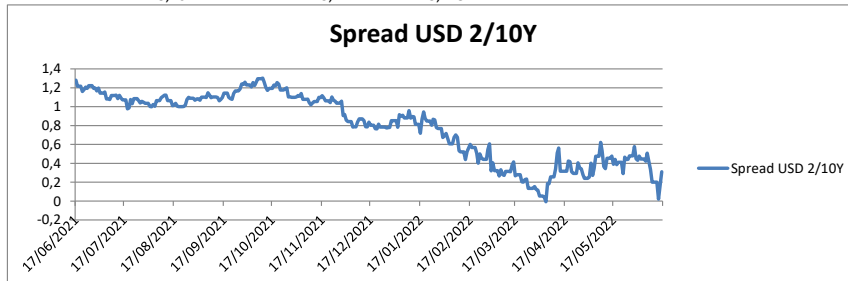
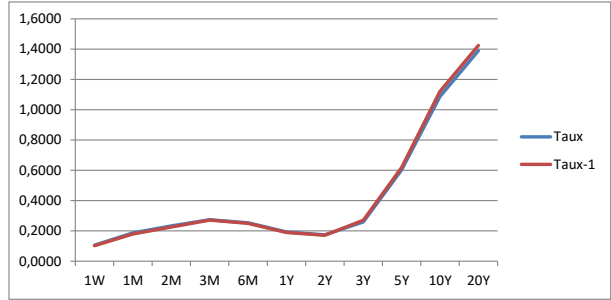


EURIBOR3M	13/06/2022	13/06/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,182					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22		100,281	#VALEUR!		-0,281	#VALEUR!
I SEP22	99,205	99,21	0,795		98,410	0,790
I DEC22	98,44	98,43	1,560		96,880	1,570
I MAR23	97,92	97,895	2,080		95,840	2,105
I JUN23	97,66	97,63	2,340		95,320	2,370
I SEP23	97,535	97,5	2,465		95,070	2,500
I DEC23	97,505	97,47	2,495		95,010	2,530
I MAR24	97,52	97,495	2,480		95,040	2,505
I JUN24	97,565	97,54	2,435		95,130	2,460
I SEP24	97,585	97,565	2,415		95,170	2,435
I DEC24	97,59	97,57	2,410		95,180	2,430
I MAR25	97,585	97,57	2,415		95,170	2,430



TAUX US EMPRUNTEUR 

	16/06/2022	14/06/2022	Δ
SOFR	0,7000	0,6900	0,690
SOFR 30 Day	0,7706	0,7772	0,777
SOFR 90 Day	0,5148	0,5032	0,503
SOFR 180 Day	0,2835	0,2763	0,276
16/06/2022 15/06/2022			
USA Benchmark 1Y	2,6851	2,7043	2,704
US Benchmark 2Y	3,1264	3,3177	3,318
US Benchmark 3Y	3,4838	3,4817	3,482
US Benchmark 5Y	3,4125	3,5407	3,541
US Benchmark 10Y	3,4362	3,4863	3,486
US Benchmark 20Y	3,6822	3,7024	3,702
US Benchmark 30Y	3,4047	3,4147	3,415



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	14/06/2022	13/06/2022	Δ
SONIA	0,9398	0,9396	0,9396
LIBOR 1M GBP Synth	1,2798	1,2942	1,2942
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,5891	1,6044	1,6044
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,1692	2,1922	2,1922

	16/06/2022	15/06/2022	Δ
UK Benchmark 1Y	1,9998	1,9909	1,99091
UK Benchmark 2Y	2,2917	2,0585	2,058456
UK Benchmark 3Y	2,4065	2,1765	2,17652
UK Benchmark 4Y	2,2370	2,1257	2,125654
UK Benchmark 5Y	2,1848	2,0862	2,086228
UK Benchmark 6Y	2,3528	2,1664	2,166424
UK Benchmark 7Y	2,4633	2,3149	2,314947
UK Benchmark 8Y	2,4502	2,3013	2,301345
UK Benchmark 9Y	2,3860	2,4904	2,49041
UK Benchmark 10Y	2,5953	2,4628	2,462775
UK Benchmark 12Y	2,7411	2,6295	2,629465
UK Benchmark 15Y	2,7266	2,7048	2,704779
UK Benchmark 20Y	2,8113	2,7071	2,707057

