

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
608 - Echec de connexion : td	3,23%	3,23%	3,24	-0,011
DE Benchmark 10Y	1,72%	1,71%	1,69	0,021
FR Benchmark 10Y	2,26%	2,25%	2,25	0,0038
FR Benchmark 5Y	1,81%	1,79%	1,80	0,006
UK Benchmark 10Y	2,52%	2,51%	2,48	0,039
608 - Echec de connexion : td	2,35			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
608 - Echec de connexion : td	118,21	117,59
Petrole Brut Baril	120,52	119,81
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,581	4,5713
Gaz naturel	7,425	7,464
Or 1 Oc	1848,8165	1857,5

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
608 - Echec de connexion : td	1,0525	1,05234
EUR/JPY	141,205	141,193
EUR/GBP	0,85547	0,8554
EUR/CAD	1,36405	1,36385
EUR/CNY	7,05408	7,04633
EUR/BRL	5,32232	5,31623

Pt de terme	EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
1 mois	VENTE		VENTE	
3 mois	608 - Echec de connexion :	20,05	608 - Echec de c	12,71
6 mois		65,94		40,81
		138,61		139,93
				82,56
				84,41

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
608 - Echec de connexion : td	-0,73	-0,43
Deposits EUR 1M	-0,73	-0,43
Deposits EUR 2M	-0,58	-0,28
Deposits EUR 3M	-0,5	-0,2
Deposits EUR 6M	0,04	0,34
Deposits EUR 12M	0,82	1,12

FIXING	TAUX	DATE
608 - Echec de connexion :	-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

	608 - Echec de connexion : td	608 - Echec de connexion : td
608 - Echec de connexion : td	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 TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
608 - Echec de connexion : td		
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
608 - Echec de connexion :	-0,593	-0,552
OIS EUR 3M	-0,341	-0,3
OIS EUR 6M	0,118	0,159
OIS EUR 1Y	0,868	0,909
OIS EUR 2Y	1,535	1,576
OIS EUR 3Y	1,743	1,784

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
608 - Echec de connexion : td	0,15	0,17
FRA EUR 2x5	0,469	0,489
FRA EUR 3x6	0,789	0,809
FRA EUR 6x9	1,556	1,576
FRA EUR 9x12	2,088	2,108
FRA EUR 3x9	1,164	1,184
FRA EUR 6x12	1,808	1,828
FRA EUR 9x15	2,237	2,257
FRA EUR 12x24	2,791	2,811

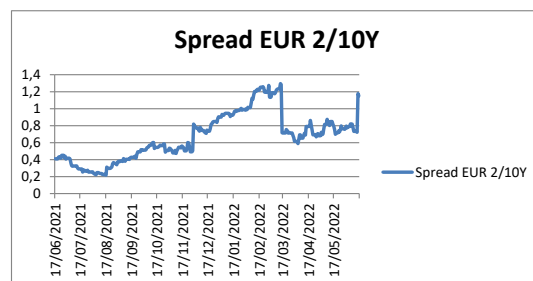
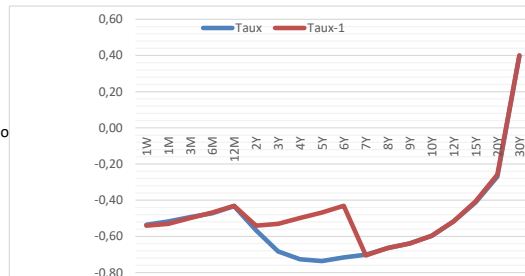
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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
608 - Echech de connexion :	1,072	1,112
IRS EUR 2Y	1,758	1,798
IRS EUR 3Y	1,967	2,007
IRS EUR 4Y	2,085	2,125
IRS EUR 5Y	2,171	2,211
IRS EUR 6Y	2,219	2,259
IRS EUR 7Y	2,271	2,311
IRS EUR 10Y	2,436	2,476

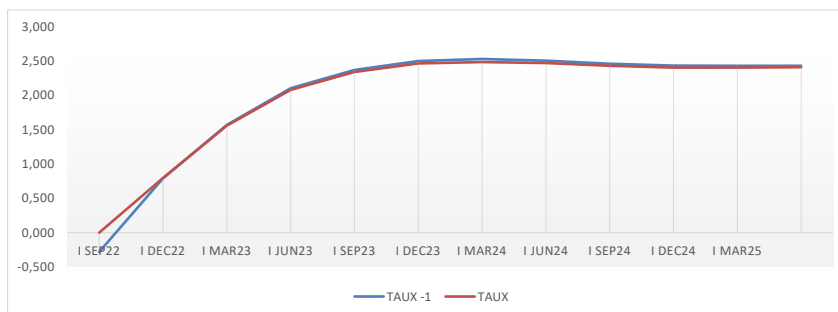


TAUX EURIBOR	608 - Echech de connexion : tc	608 - Echech de connexion :	Δ
608 - Echech de connexion : tc	-0,57	-0,57	0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,49	-0,51	0,018
EURIBOR 3M EUR	-0,18	-0,24	0,061
EURIBOR 6M EUR	0,24	0,18	0,062
EURIBOR 12M EUR	1,07	0,96	0,110
608 - Echech de connexion : tc	608 - Echech de connexion : tc	608 - Echech de connexion : toolbar déco	
608 - Echech de connexion : tc	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



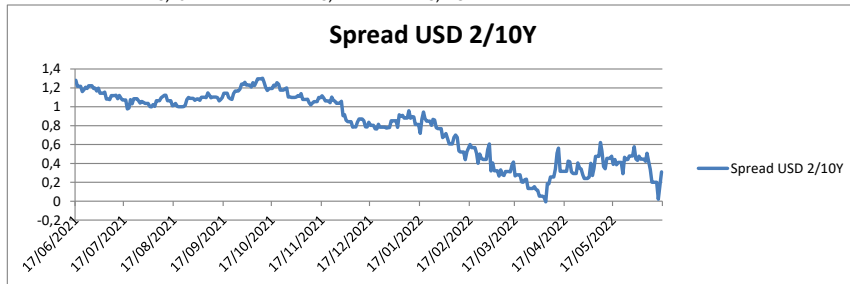
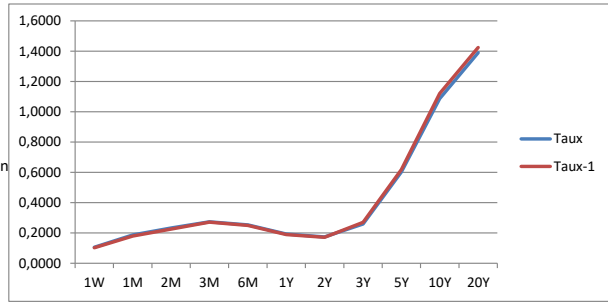
EURIBOR3M

LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	608 - Echech de connexion : tc	608 - Echech de connexion :	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
608 - Echech de connexion : tc	-0,182		100,281	#VALEUR!	#VALEUR!	-0,281
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	97,515	97,47	2,485		95,030	2,530
I MAR24	97,53	97,495	2,470		95,060	2,505
I JUN24	97,57	97,54	2,430		95,140	2,460
I SEP24	97,595	97,565	2,405		95,190	2,435
I DEC24	97,595	97,57	2,405		95,190	2,430
I MAR25	97,59	97,57	2,410		95,180	2,430



TAUX US EMPRUNTEUR

608 - Echec de connexion : tc	608 - Echec de connexion : ta	608 - Echec de connexion : toolbar déconn	Δ
608 - Echec de connexion : tc	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
608 - Echec de connexion : tc	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

608 - Echec de connexion : tc	608 - Echec de connexion : ta	608 - Echec de connexion : toolbar déconn	Δ
608 - Echec de connexion : tc	0,9398	0,9396	0,9396
LIBOR 1M GBP Synth	1,2798	1,2942	1,2942
LIBOR 3M/ GBP Synth	1,5891	1,6044	1,6044
LIBOR 6M/ GBP Synth	2,1692	2,1922	2,1922
608 - Echec de connexion : tc	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

