

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,15%	3,15%	3,10	0,050
DE Benchmark 10Y	1,64%	1,63%	1,49	0,151
FR Benchmark 10Y	2,17%	2,16%	2,02	0,1414
FR Benchmark 5Y	1,68%	1,67%	1,50	0,177
UK Benchmark 10Y	2,50%	2,49%	2,40	0,102
TEC 10	2,27			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	104,11	106,19
Petrole Brut Baril	109,82	111,74
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,3483	4,4046
Gaz naturel	6,747	6,858
Or 1 Oc	1837,72	1837,69

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0511	1,0507
EUR/JPY	142,266	142,24
EUR/GBP	0,8627	0,86234
EUR/CAD	1,36426	1,3639
EUR/CNY	7,05306	7,04511
EUR/BRL	5,46294	5,45623

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	20,24	20,42	12,65	12,94
3 mois	68,41	68,83	41,24	41,96
6 mois	144,54	145,71	84,7	86,64

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,72	-0,42
Deposit EUR 2M	-0,57	-0,27
Deposit EUR 3M	-0,46	-0,16
Deposit EUR 6M	0,06	0,36
Deposit EUR 12M	0,79	1,09

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,579	22/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,563	21/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,512	21/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,163	21/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,289	21/06/2022
EURIBOR 12M EUR	1,115	21/06/2022

	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	99,365	99,37
I DEC22	98,67	98,675
I MAR23	98,2	98,205
I JUN23	97,965	97,97

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,599	-0,558
OIS EUR 3M	-0,326	-0,285
OIS EUR 6M	0,076	0,117
OIS EUR 1Y	0,715	0,756
OIS EUR 2Y	1,282	1,323
OIS EUR 3Y	1,463	1,504

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,103	0,123
FRA EUR 2x5	0,392	0,412
FRA EUR 3x6	0,649	0,669
FRA EUR 6x9	1,311	1,331
FRA EUR 9x12	1,766	1,786
FRA EUR 3x9	1,005	1,025
FRA EUR 6x12	1,564	1,584
FRA EUR 9x15	1,927	1,947
FRA EUR 12x24	2,066	2,086

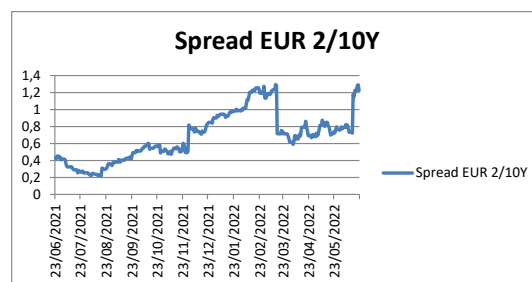
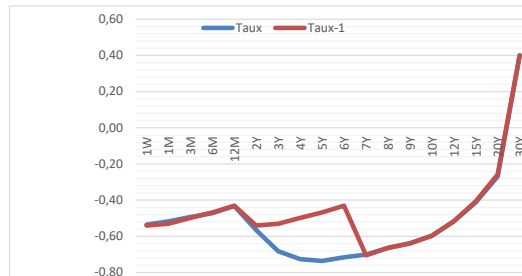
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

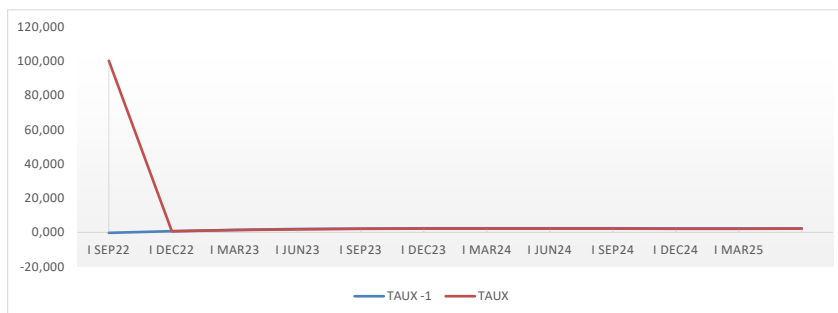
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,892	0,932
IRS EUR 2Y	1,498	1,538
IRS EUR 3Y	1,687	1,727
IRS EUR 4Y	1,808	1,848
IRS EUR 5Y	1,892	1,932
IRS EUR 6Y	1,968	2,008
IRS EUR 7Y	2,035	2,075
IRS EUR 10Y	2,228	2,268



	21/06/2022	20/06/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,56	-0,57	0,005
EURIBOR 1M EUR	-0,51	-0,50	-0,012
EURIBOR 3M EUR	-0,16	-0,18	0,015
EURIBOR 6M EUR	0,29	0,27	0,016
EURIBOR 12M EUR	1,12	1,09	0,024
	22/06/2022	21/06/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,94	1,05	-0,103
XEU Benchmark 3Y	1,16	1,29	-0,126
XEU Benchmark 4Y	1,56	1,69	-0,134
XEU Benchmark 5Y	1,67	1,82	-0,152
XEU Benchmark 6Y	1,47	1,62	-0,146
XEU Benchmark 7Y	1,49	1,63	-0,143
XEU Benchmark 8Y	1,52	1,66	-0,142
XEU Benchmark 9Y	2,01	2,18	-0,171
XEU Benchmark 10Y	2,17	2,34	-0,170
XEU Benchmark 12Y	2,32	2,48	-0,163
XEU Benchmark 15Y	1,82	1,97	-0,147
XEU Benchmark 20Y	1,82	1,96	-0,139
TEC 30	2,73	2,63	0,100

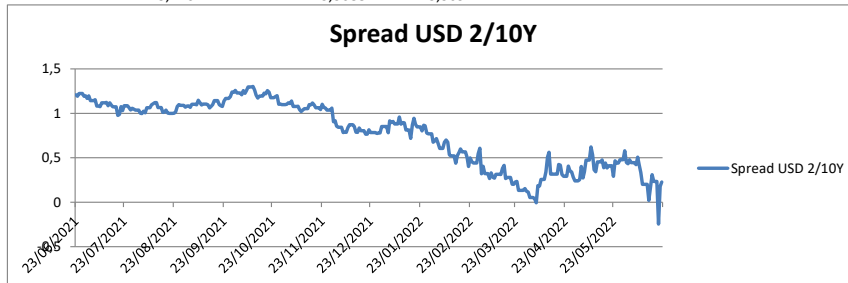
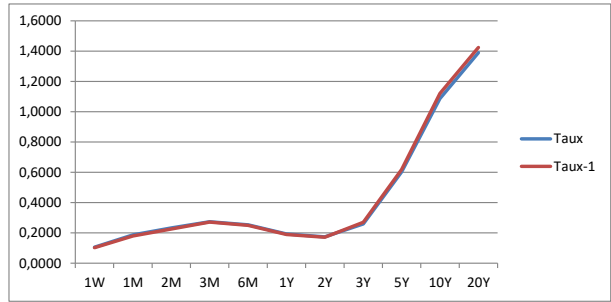


EURIBOR3M	13/06/2022	13/06/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,163					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22		100,281	100,000		-100,000	-0,281
I SEP22	99,37	99,31	0,630		98,740	0,690
I DEC22	98,675	98,555	1,325		97,350	1,445
I MAR23	98,205	98,045	1,795		96,410	1,955
I JUN23	97,97	97,79	2,030		95,940	2,210
I SEP23	97,855	97,66	2,145		95,710	2,340
I DEC23	97,825	97,62	2,175		95,650	2,380
I MAR24	97,84	97,625	2,160		95,680	2,375
I JUN24	97,875	97,66	2,125		95,750	2,340
I SEP24	97,885	97,685	2,115		95,770	2,315
I DEC24	97,885	97,695	2,115		95,770	2,305
I MAR25	97,875	97,695	2,125		95,750	2,305



TAUX US EMPRUNTEUR 

	22/06/2022	17/06/2022	Δ
SOFR	1,4500	1,4500	1,450
SOFR 30 Day	0,9033	0,7922	0,792
SOFR 90 Day	0,5922	0,5276	0,528
SOFR 180 Day	0,3303	0,2913	0,291
	22/06/2022	21/06/2022	
USA Benchmark 1Y	2,9501	2,7207	2,721
US Benchmark 2Y	3,0719	3,1698	3,170
US Benchmark 3Y	3,2444	3,3997	3,400
US Benchmark 5Y	3,3620	3,4104	3,410
US Benchmark 10Y	3,2996	3,3483	3,348
US Benchmark 20Y	3,4862	3,6472	3,647
US Benchmark 30Y	3,2462	3,3688	3,369



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	20/06/2022	17/06/2022	Δ
SONIA	1,1896	1,1895	1,1895
LIBOR 1M GBP Synth	1,2267	1,2277	1,2277
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,6247	1,6126	1,6126
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,3011	2,2857	2,2857
	22/06/2022	21/06/2022	
UK Benchmark 1Y	2,1382	2,1117	2,111674
UK Benchmark 2Y	2,2216	2,4225	2,422543
UK Benchmark 3Y	2,2784	2,5096	2,509562
UK Benchmark 4Y	2,2377	2,4075	2,407455
UK Benchmark 5Y	2,1726	2,3442	2,344177
UK Benchmark 6Y	2,1941	2,4185	2,418462
UK Benchmark 7Y	2,3150	2,5106	2,510553
UK Benchmark 8Y	2,3204	2,5191	2,519059
UK Benchmark 9Y	2,5315	2,5601	2,560146
UK Benchmark 10Y	2,4922	2,6927	2,692711
UK Benchmark 12Y	2,6581	2,8367	2,836701
UK Benchmark 15Y	2,7702	2,9158	2,915751
UK Benchmark 20Y	2,7629	2,9602	2,96024

