

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,08%	3,08%	3,06	0,023
DE Benchmark 10Y	1,43%	1,42%	1,37	0,057
FR Benchmark 10Y	1,97%	1,96%	1,91	0,0577
FR Benchmark 5Y	1,45%	1,43%	1,54	-0,098
UK Benchmark 10Y	2,32%	2,31%	2,27	0,046
TEC 10	1,99			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	104,31	104,27
Petrole Brut Baril	109,97	110,05
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,3302	4,3379
Gaz naturel	6,104	6,239
Or 1 Oc	1829,66	1822,3

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0524	1,05219
EUR/JPY	141,63	141,616
EUR/GBP	0,85792	0,85785
EUR/CAD	1,368	1,364
EUR/CNY	7,04982	7,04152
EUR/BRL	5,5171	5,51057

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	19,96	20,23	12,39	12,71
3 mois	68,1	68,73	40,37	41,15
6 mois	144,72	146,53	83,85	86,01

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-0,73	-0,43
Deposît EUR 1M	-0,73	-0,43
Deposît EUR 2M	-0,59	-0,29
Deposît EUR 3M	-0,47	-0,17
Deposît EUR 6M	0,04	0,34
Deposît EUR 12M	0,72	1,02

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,578	23/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,569	22/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,512	22/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,172	22/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,291	22/06/2022
EURIBOR 12M EUR	1,108	22/06/2022

	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	99,45	99,455
I DEC22	98,82	98,825
I MAR23	98,405	98,41
I JUN23	98,2	98,21

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,59	-0,549
OIS EUR 3M	-0,327	-0,286
OIS EUR 6M	0,049	0,09
OIS EUR 1Y	0,631	0,672
OIS EUR 2Y	1,143	1,184
OIS EUR 3Y	1,315	1,356

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,074	0,094
FRA EUR 2x5	0,344	0,364
FRA EUR 3x6	0,601	0,621
FRA EUR 6x9	1,213	1,233
FRA EUR 9x12	1,627	1,647
FRA EUR 3x9	0,943	0,963
FRA EUR 6x12	1,514	1,534
FRA EUR 9x15	1,793	1,813
FRA EUR 12x24	1,791	1,811

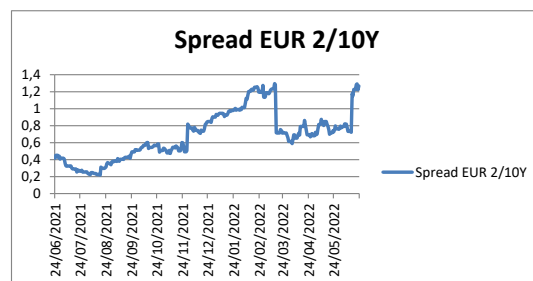
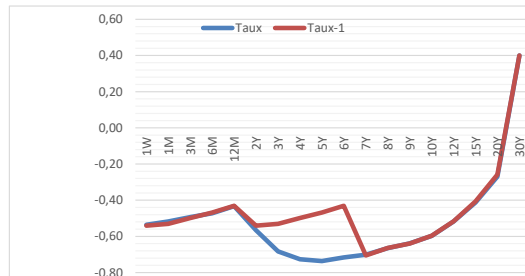
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

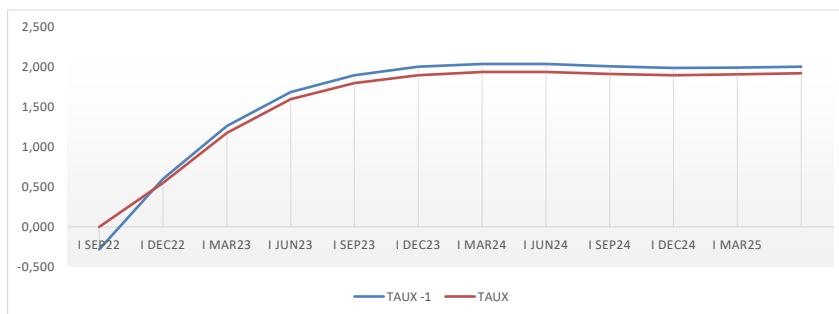
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,815	0,855
IRS EUR 2Y	1,353	1,393
IRS EUR 3Y	1,53	1,57
IRS EUR 4Y	1,671	1,711
IRS EUR 5Y	1,776	1,816
IRS EUR 6Y	1,851	1,891
IRS EUR 7Y	1,92	1,96
IRS EUR 10Y	2,113	2,153



TAUX EURIBOR	22/06/2022	21/06/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,56	-0,006
EURIBOR 1M EUR	-0,51	-0,51	0,000
EURIBOR 3M EUR	-0,17	-0,16	-0,009
EURIBOR 6M EUR	0,29	0,29	0,002
EURIBOR 12M EUR	1,11	1,12	-0,007
	23/06/2022	22/06/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,71	0,94	-0,230
XEU Benchmark 3Y	0,91	1,16	-0,248
XEU Benchmark 4Y	1,33	1,56	-0,232
XEU Benchmark 5Y	1,44	1,67	-0,229
XEU Benchmark 6Y	1,23	1,47	-0,248
XEU Benchmark 7Y	1,24	1,49	-0,243
XEU Benchmark 8Y	1,29	1,52	-0,231
XEU Benchmark 9Y	1,82	2,01	-0,190
XEU Benchmark 10Y	1,98	2,17	-0,185
XEU Benchmark 12Y	2,16	2,32	-0,162
XEU Benchmark 15Y	1,63	1,82	-0,188
XEU Benchmark 20Y	1,66	1,82	-0,166
TEC 30	2,50	2,73	-0,230

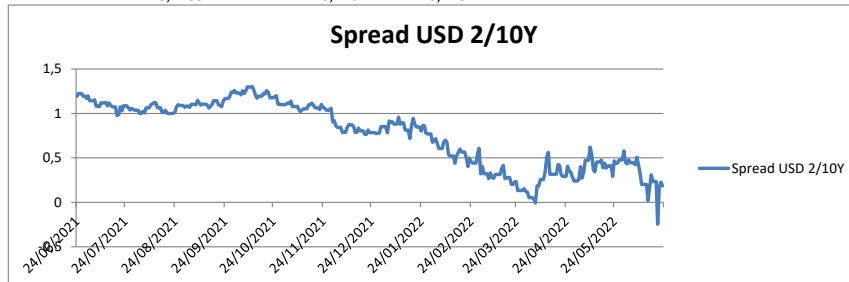
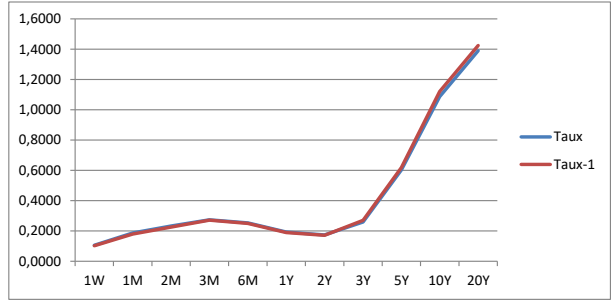


EURIBOR3M	13/06/2022	13/06/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
EURIBOR 3M EUR	-0,172					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS						
I JUN22	100,281	100,281	#VALEUR!		#VALEUR!	-0,281
I SEP22	99,45	99,4	0,550		98,900	0,600
I DEC22	98,825	98,74	1,175		97,650	1,260
I MAR23	98,405	98,315	1,595		96,810	1,685
I JUN23	98,205	98,105	1,795		96,410	1,895
I SEP23	98,105	98	1,895		96,210	2,000
I DEC23	98,065	97,965	1,935		96,130	2,035
I MAR24	98,065	97,965	1,935		96,130	2,035
I JUN24	98,09	97,995	1,910		96,180	2,005
I SEP24	98,105	98,015	1,895		96,210	1,985
I DEC24	98,095	98,01	1,905		96,190	1,990
I MAR25	98,08	98	1,920		96,160	2,000



TAUX US EMPRUNTEUR 

	23/06/2022	21/06/2022	Δ
SOFR	1,4500	1,4500	1,450
SOFR 30 Day	0,9257	0,8810	0,881
SOFR 90 Day	0,6053	0,5791	0,579
SOFR 180 Day	0,3381	0,3225	0,322
USA Benchmark 1Y			
USA Benchmark 1Y	2,8673	2,9501	2,950
US Benchmark 2Y	2,9542	3,0719	3,072
US Benchmark 3Y	3,1245	3,2444	3,244
US Benchmark 5Y	3,2453	3,3620	3,362
US Benchmark 10Y	3,1399	3,2996	3,300
US Benchmark 20Y	3,4073	3,4862	3,486
US Benchmark 30Y	3,1785	3,2462	3,246



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	21/06/2022	20/06/2022	Δ
SONIA	1,1892	1,1896	1,1896
LIBOR 1M GBP Synth	1,2251	1,2267	1,2267
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,6193	1,6247	1,6247
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,2567	2,3011	2,3011
UK Benchmark 1Y			
UK Benchmark 1Y	1,9924	2,1382	2,138213
UK Benchmark 2Y	2,0394	2,2216	2,2216
UK Benchmark 3Y	2,0810	2,2784	2,278368
UK Benchmark 4Y	2,0207	2,2377	2,237746
UK Benchmark 5Y	1,9543	2,1726	2,172632
UK Benchmark 6Y	2,0071	2,1941	2,194135
UK Benchmark 7Y	2,1274	2,3150	2,314953
UK Benchmark 8Y	2,1512	2,3204	2,320449
UK Benchmark 9Y	2,3988	2,5315	2,531473
UK Benchmark 10Y	2,3303	2,4922	2,492179
UK Benchmark 12Y	2,5164	2,6581	2,658051
UK Benchmark 15Y	2,6011	2,7702	2,770173
UK Benchmark 20Y	2,6323	2,7629	2,762925

