

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,02%	3,02%	2,96	0,057
DE Benchmark 10Y	1,34%	1,33%	1,35	-0,007
FR Benchmark 10Y	1,95%	1,94%	1,94	0,0133
FR Benchmark 5Y	1,51%	1,50%	1,49	0,020
UK Benchmark 10Y	2,24%	2,23%	2,24	0,000
TEC 10	1,99			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	105,09	105,76
Petrole Brut Baril	108,56	114,81
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,8423	3,8305
Gaz naturel	5,681	5,424
Or 1 Oc	1797,212	1807,05

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0451	1,0447
EUR/JPY	140,985	140,975
EUR/GBP	0,86196	0,8617
EUR/CAD	1,352	1,348
EUR/CNY	7,01212	7,00455
EUR/BRL	5,49208	5,48566

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	21,12	21,4	12,65	13,08
3 mois	68,95	69,58	41,14	42,22
6 mois	153,74	156,2	85,54	89,86

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposît EUR ON	-1,04	-0,74
Deposît EUR 1M	-0,67	-0,37
Deposît EUR 2M	-0,55	-0,25
Deposît EUR 3M	-0,41	-0,11
Deposît EUR 6M	0,05	0,35
Deposît EUR 12M	0,65	0,95

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,591	30/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,563	29/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,535	29/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,191	29/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,278	29/06/2022
EURIBOR 12M EUR	1,068	29/06/2022

	30/06/2022	31/05/2022
TMO	2,28	1,76
TME	2,08	1,56
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	
instrument inconnu	instrument inconnu	instrument inconnu
I SEP22	99,5	99,505
I DEC22	98,9	98,905
I MAR23	98,535	98,54
I JUN23	98,305	98,315

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,516	-0,475
OIS EUR 3M	-0,272	-0,231
OIS EUR 6M	0,103	0,144
OIS EUR 1Y	0,628	0,669
OIS EUR 2Y	1,105	1,146
OIS EUR 3Y	1,268	1,309

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,08	0,1
FRA EUR 2x5	0,339	0,359
FRA EUR 3x6	0,582	0,602
FRA EUR 6x9	1,163	1,183
FRA EUR 9x12	1,512	1,532
FRA EUR 3x9	0,914	0,934
FRA EUR 6x12	1,446	1,466
FRA EUR 9x15	1,683	1,703
FRA EUR 12x24	1,681	1,701

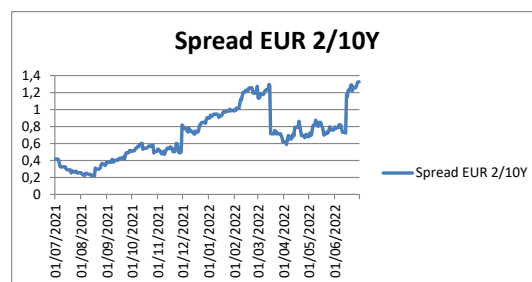
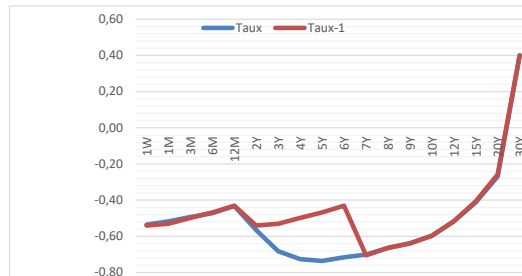
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

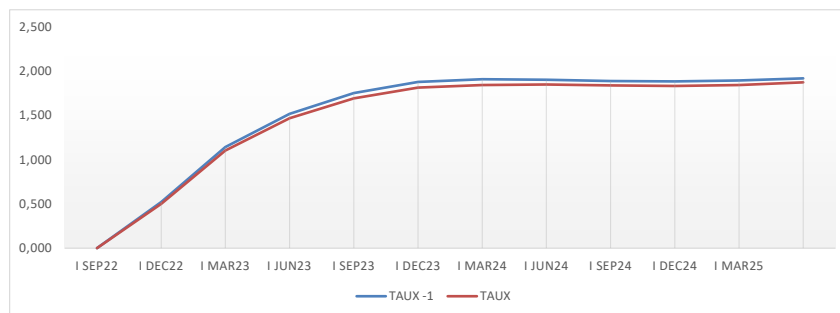
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,761	0,801
IRS EUR 2Y	1,285	1,325
IRS EUR 3Y	1,466	1,506
IRS EUR 4Y	1,608	1,648
IRS EUR 5Y	1,715	1,755
IRS EUR 6Y	1,812	1,852
IRS EUR 7Y	1,901	1,941
IRS EUR 10Y	2,136	2,176



TAUX EURIBOR	29/06/2022	28/06/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,56	-0,57	0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,54	-0,54	0,001
EURIBOR 3M EUR	-0,19	-0,21	0,020
EURIBOR 6M EUR	0,28	0,23	0,053
EURIBOR 12M EUR	1,07	1,02	0,046
XEU Benchmark 2Y	0,74	0,86	-0,116
XEU Benchmark 3Y	0,95	1,08	-0,126
XEU Benchmark 4Y	1,38	1,49	-0,118
XEU Benchmark 5Y	1,49	1,62	-0,132
XEU Benchmark 6Y	1,31	1,44	-0,125
XEU Benchmark 7Y	1,34	1,46	-0,120
XEU Benchmark 8Y	1,38	1,50	-0,114
XEU Benchmark 9Y	1,90	2,00	-0,104
XEU Benchmark 10Y	2,07	2,17	-0,105
XEU Benchmark 12Y	2,23	2,33	-0,102
XEU Benchmark 15Y	1,73	1,83	-0,095
XEU Benchmark 20Y	1,74	1,83	-0,085
TEC 30	2,52	2,62	-0,100

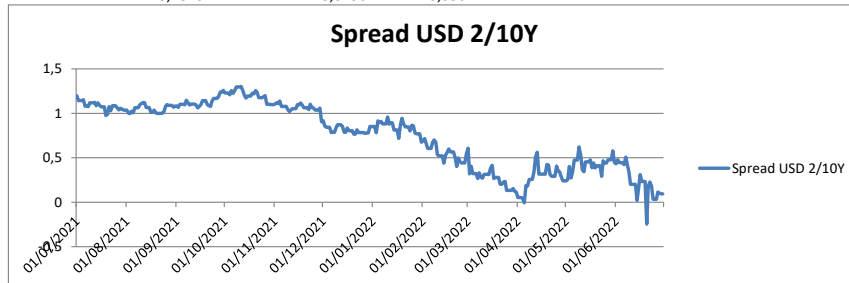
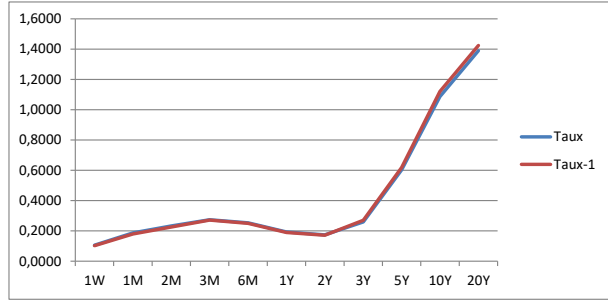



EURIBOR3M		EURIBOR 3M EUR		-0,191		
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	instrument inconnu	instrument inconnu	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
instrument inconnu	instrument inconnu	instrument inconnu	#VALEUR!	#VALEUR!	#VALEUR!	#VALEUR!
I SEP22	99,5	99,48	0,500	99,000	0,520	0,691
I DEC22	98,9	98,86	1,100	97,800	1,140	1,291
I MAR23	98,535	98,485	1,465	97,070	1,515	1,656
I JUN23	98,31	98,25	1,690	96,620	1,750	1,881
I SEP23	98,19	98,125	1,810	96,380	1,875	2,001
I DEC23	98,16	98,095	1,840	96,320	1,905	2,031
I MAR24	98,155	98,1	1,845	96,310	1,900	2,036
I JUN24	98,165	98,115	1,835	96,330	1,885	2,026
I SEP24	98,17	98,12	1,830	96,340	1,880	2,021
I DEC24	98,16	98,11	1,840	96,320	1,890	2,031
I MAR25	98,13	98,085	1,870	96,260	1,915	2,061



TAUX US EMPRUNTEUR 

	30/06/2022	28/06/2022	Δ
SOFR	1,5100	1,5200	1,520
SOFR 30 Day	1,0888	1,0398	1,040
SOFR 90 Day	0,6987	0,6712	0,671
SOFR 180 Day	0,3937	0,3774	0,377
	29/06/2022	28/06/2022	
USA Benchmark 1Y	3,0012	2,9961	2,996
US Benchmark 2Y	3,0990	3,1472	3,147
US Benchmark 3Y	3,2139	3,2867	3,287
US Benchmark 5Y	3,2855	3,3348	3,335
US Benchmark 10Y	3,1932	3,2476	3,248
US Benchmark 20Y	3,4857	3,6007	3,601
US Benchmark 30Y	3,2823	3,3496	3,350



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	28/06/2022	27/06/2022	Δ
SONIA	1,1877	1,1884	1,1884
LIBOR 1M GBP Synth	1,2262	1,2250	1,225
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,6729	1,6644	1,6644
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,2796	2,2848	2,2848
	29/06/2022	28/06/2022	
UK Benchmark 1Y	1,9753	1,9664	1,96639
UK Benchmark 2Y	2,1941	2,2566	2,256598
UK Benchmark 3Y	2,2266	2,2829	2,282941
UK Benchmark 4Y	2,1454	2,2296	2,229627
UK Benchmark 5Y	2,0968	2,1800	2,180037
UK Benchmark 6Y	2,1232	2,2024	2,202415
UK Benchmark 7Y	2,2441	2,3287	2,328655
UK Benchmark 8Y	2,2709	2,3524	2,352375
UK Benchmark 9Y	2,4346	2,4146	2,414635
UK Benchmark 10Y	2,4419	2,5417	2,541738
UK Benchmark 12Y	2,6568	2,7454	2,745354
UK Benchmark 15Y	2,7285	2,7921	2,792144
UK Benchmark 20Y	2,7557	2,8236	2,823616

