21/04/2022

FINANCESCOOP
45 Rue de Naples 75008 Paris
Tél : 01 43 19 75 56

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,84%	2,84%	2,86	-0,024
DE Benchmark 10Y	0,86%	0,85%	0,91	-0,052
FR Benchmark 10Y	1,34%	1,34%	1,37	-0,0261
FR Benchmark 5Y	0,82%	0,80%	0,88	-0,062
UK Benchmark 10Y	1,92%	1,91%	1,95	-0,027
TEC 10	1,33			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	104,05	102,19
Petrole Brut Baril	108,85	106,8
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,9951	3,9731
Gaz naturel	6,862	6,937
Or 1 Oc	1951,468	1957,8

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,092	1,0917
EUR/JPY	139,694	139,686
EUR/GBP	0,83552	0,83535
EUR/CAD	1,36106	1,36066
EUR/CNY	7,0386	7,0304
EUR/BRL	5,0496	5,0428

	EUR/USD		EUR/GBP	
Pt de terme	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	12,2	12,3	10,3	10,49
3 mois	47,06	47,31	35,29	35,69
6 mois	112,65	113,24	77,05	77,93

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,77	-0,47
Deposit EUR 1M	-0,77	-0,47
Deposit EUR 2M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 3M	-0,75	-0,45
Deposit EUR 6M	-0,52	-0,22
Deposit EUR 12M	-0,19	0,11

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,583	20/04/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,572	19/04/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,56	19/04/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,468	19/04/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,333	19/04/2022
EURIBOR 12M EUR	-0,01	19/04/2022

	31/03/2022	28/02/2022
TMO	1	0,88
TME	0,8	0,68
TMM	-0,4936	-0,4916
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,546	-0,553
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,496	-0,532

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TA	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I JUN22	100,295	100,3
I SEP22	99,94	99,945
I DEC22	99,56	99,565
I MAR23	99,125	99,13
I JUN23	98,745	98,75

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,597	-0,556
OIS EUR 3M	-0,584	-0,543
OIS EUR 6M	-0,446	-0,405
OIS EUR 1Y	-0,109	-0,068
OIS EUR 2Y	0,53	0,571
OIS EUR 3Y	0,804	0,845

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,381	-0,361
FRA EUR 2x5	-0,266	-0,246
FRA EUR 3x6	-0,155	-0,135
FRA EUR 6x9	0,146	0,166
FRA EUR 9x12	0,642	0,662
FRA EUR 3x9	0,035	0,055
FRA EUR 6x12	0,456	0,476
FRA EUR 9x15	0,903	0,923
FRA EUR 12x24	1,855	1,875

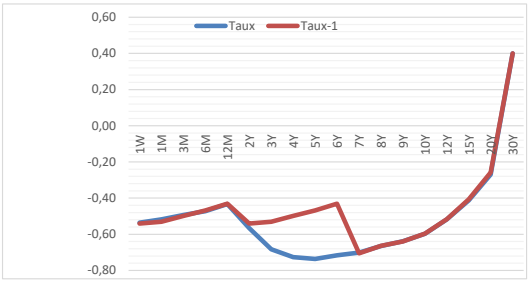
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

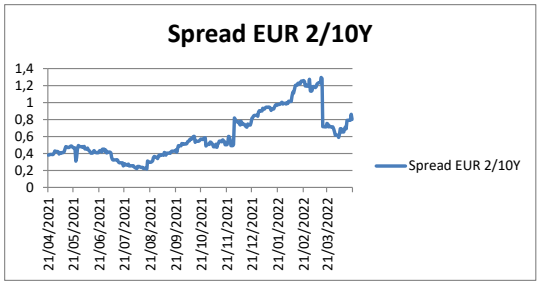
Sensitivity: C2 Internal

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

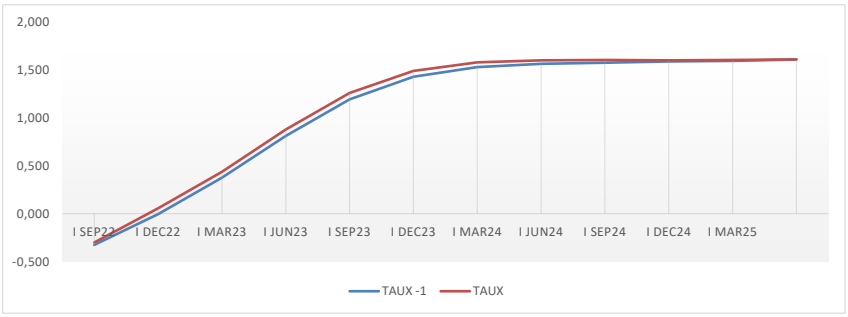
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,026	0,066
IRS EUR 2Y	0,702	0,742
IRS EUR 3Y	0,993	1,033
IRS EUR 4Y	1,144	1,184
IRS EUR 5Y	1,231	1,271
IRS EUR 6Y	1,296	1,336
IRS EUR 7Y	1,356	1,396
IRS EUR 10Y	1,533	1,573

TAUX EURIBOR	19/04/2022	14/04/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,56	-0,012
EURIBOR 1M EUR	-0,56	-0,55	-0,013
EURIBOR 3M EUR	-0,47	-0,45	-0,016
EURIBOR 6M EUR	-0,33	-0,32	-0,016
EURIBOR 12M EUR	-0,01	0,00	-0,013
	20/04/2022	19/04/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,06	0,06	0,000
XEU Benchmark 3Y	0,30	0,31	-0,013
XEU Benchmark 4Y	0,65	0,66	-0,018
XEU Benchmark 5Y	0,81	0,83	-0,023
XEU Benchmark 6Y	0,63	0,67	-0,033
XEU Benchmark 7Y	0,69	0,73	-0,042
XEU Benchmark 8Y	0,73	0,78	-0,051
XEU Benchmark 9Y	0,79	0,85	-0,058
XEU Benchmark 10Y	0,86	0,92	-0,061
XEU Benchmark 12Y	1,45	1,51	-0,063
XEU Benchmark 15Y	0,98	1,06	-0,077
XEU Benchmark 20Y	0,93	1,01	-0,080
TEC 30	1,79	1,84	-0,050





EURIBOR3M						
EURIBOR 3M EUR	-0,468					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	21/04/2022	20/04/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
I JUN22	100,3	100,325	-0,300	100,600	-0,325	0,168
I SEP22	99,945	100,005	0,055	99,890	-0,005	0,523
I DEC22	99,565	99,625	0,435	99,130	0,375	0,903
I MAR23	99,125	99,19	0,875	98,250	0,810	1,343
I JUN23	98,745	98,81	1,255	97,490	1,190	1,723
I SEP23	98,515	98,575	1,485	97,030	1,425	1,953
I DEC23	98,425	98,475	1,575	96,850	1,525	2,043
I MAR24	98,405	98,44	1,595	96,810	1,560	2,063
I JUN24	98,4	98,43	1,600	96,800	1,570	2,068
I SEP24	98,405	98,415	1,595	96,810	1,585	2,063
I DEC24	98,4	98,41	1,600	96,800	1,590	2,068
I MAR25	98,395	98,395	1,605	96,790	1,605	2,073

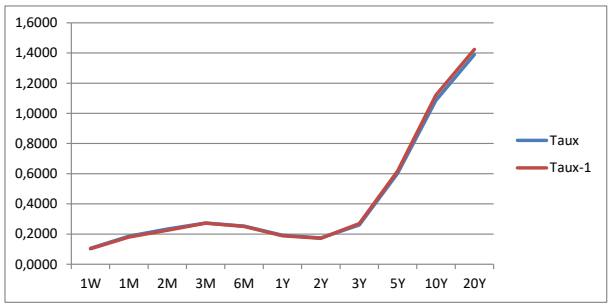


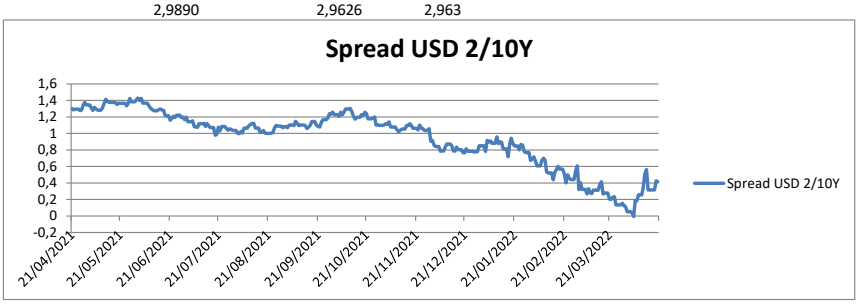
Sensitivity: C2 Internal

TAUX US EMPRUNTEUR

	19/04/2022	18/04/2022	Δ
SOFR	0,2800	0,2900	0,290
SOFR 30 Day	0,2900	0,2904	0,290
SOFR 90 Day	0,1378	0,1351	0,135
SOFR 180 Day	0,0937	0,0922	0,092

	20/04/2022	19/04/2022	
USA Benchmark 1Y	1,8173	1,8001	1,800
US Benchmark 2Y	2,5631	2,4962	2,496
US Benchmark 3Y	2,7937	2,6754	2,675
US Benchmark 5Y	2,8883	2,8629	2,863
US Benchmark 10Y	2,9807	2,9212	2,921
US Benchmark 20Y	3,1387	3,1856	3,186
US Benchmark 30Y	2,9890	2,9626	2,963

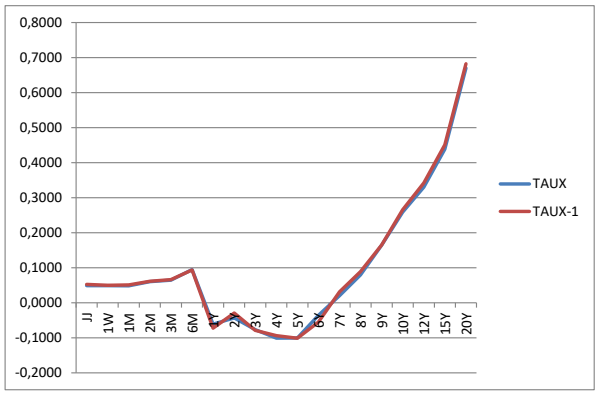


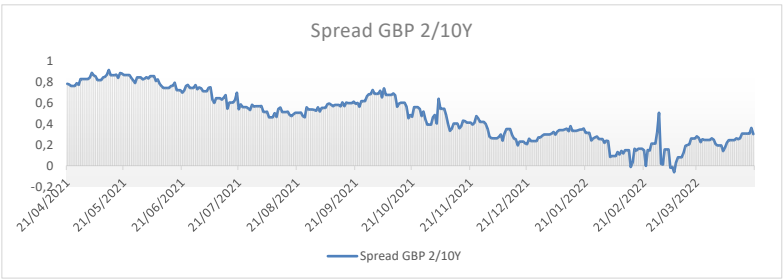


TAUX UK EMPRUNTEUR

	14/04/2022	13/04/2022	Δ
SONIA	0,6908	0,6905	0,6905
LIBOR 1M GBP Synth	0,8689	0,8307	0,8307
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,1585	1,1245	1,1245
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,5866	1,5384	1,5384

	20/04/2022	19/04/2022	
UK Benchmark 1Y	1,4589	1,4541	1,454097
UK Benchmark 2Y	1,6517	1,6562	1,656208
UK Benchmark 3Y	1,7299	1,7523	1,752289
UK Benchmark 4Y	1,6273	1,6576	1,657608
UK Benchmark 5Y	1,7290	1,7519	1,751914
UK Benchmark 6Y	1,7054	1,7534	1,753442
UK Benchmark 7Y	1,7911	1,8462	1,846161
UK Benchmark 8Y	1,7893	1,8392	1,839227
UK Benchmark 9Y	1,9526	1,9264	1,926384
UK Benchmark 10Y	1,9531	2,0170	2,016982
UK Benchmark 12Y	2,0413	2,1178	2,117756
UK Benchmark 15Y	2,0946	2,1798	2,179777
UK Benchmark 20Y	2,1643	2,2416	2,241647





Sensitivity: C2 Internal