07/06/2022

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	3,04%	3,04%	3,03	0,014
DE Benchmark 10Y	1,32%	1,31%	1,31	0,011
FR Benchmark 10Y	1,85%	1,84%	1,84	0,0152
FR Benchmark 5Y	1,29%	1,27%	1,27	0,018
UK Benchmark 10Y	2,25%	2,24%	2,25	0,002
TEC 10	1,81			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	119,12	118,5
Petrole Brut Baril	120,09	119,51
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,3714	4,3601
Gaz naturel	9,332	9,322
Or 1 Oc	1844,86	1841,4

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,06926	1,0692
EUR/JPY	141,836	141,81
EUR/GBP	0,85667	0,85662
EUR/CAD	1,3493	1,3453
EUR/CNY	7,13158	7,12428
EUR/BRL	5,13098	5,12487

	EUR/USD		EUR/GBP	
Pt de terme	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	18,16	18,24	13,02	13,17
3 mois	56,03	56,24	38,19	38,53
6 mois	116,21	116,75	75,65	76,53

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,69	-0,39
Deposit EUR 2M	-0,64	-0,34
Deposit EUR 3M	-0,55	-0,25
Deposit EUR 6M	-0,23	0,07
Deposit EUR 12M	0,26	0,56

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,59	06/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,566	03/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,538	03/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,328	03/06/2022
EURIBOR 6M EUR	-0,008	03/06/2022
EURIBOR 12M EUR	0,486	03/06/2022

	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 TAU	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I JUN22	100,24	100,245
I SEP22	99,515	99,52
I DEC22	98,985	98,99
I MAR23	98,56	98,565
I JUN23	98,265	98,27

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,587	-0,546
OIS EUR 3M	-0,422	-0,381
OIS EUR 6M	-0,096	-0,055
OIS EUR 1Y	0,436	0,477
OIS EUR 2Y	1,039	1,08
OIS EUR 3Y	1,244	1,285

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	-0,067	-0,047
FRA EUR 2x5	0,155	0,175
FRA EUR 3x6	0,398	0,418
FRA EUR 6x9	0,929	0,949
FRA EUR 9x12	1,368	1,388
FRA EUR 3x9	0,657	0,677
FRA EUR 6x12	1,163	1,183
FRA EUR 9x15	1,542	1,562
FRA EUR 12x24	2,305	2,325

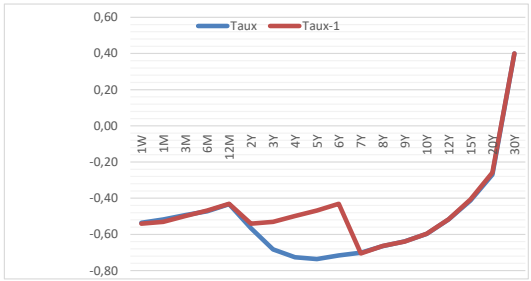
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M Fl	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M Fl	-0,511	-0,491

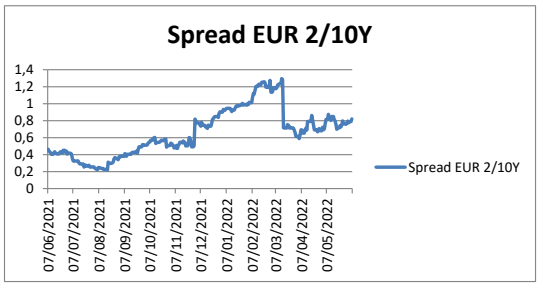
Sensitivity: C2 Internal

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

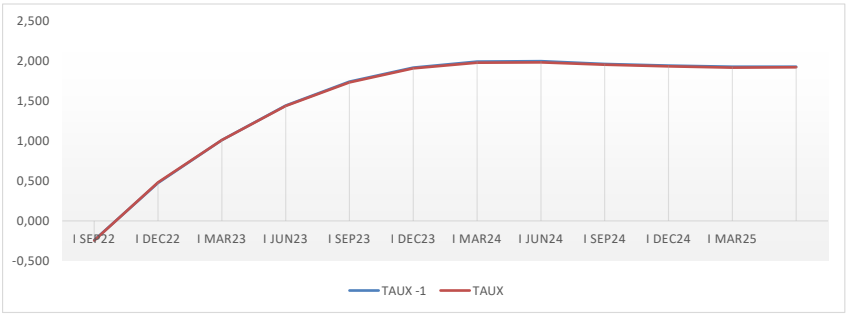
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,592	0,632
IRS EUR 2Y	1,234	1,274
IRS EUR 3Y	1,454	1,494
IRS EUR 4Y	1,567	1,607
IRS EUR 5Y	1,648	1,688
IRS EUR 6Y	1,715	1,755
IRS EUR 7Y	1,777	1,817
IRS EUR 10Y	1,967	2,007

TAUX EURIBOR	03/06/2022	02/06/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,008
EURIBOR 1M EUR	-0,54	-0,54	0,000
EURIBOR 3M EUR	-0,33	-0,33	-0,001
EURIBOR 6M EUR	-0,01	-0,02	0,009
EURIBOR 12M EUR	0,49	0,45	0,036
	06/06/2022	03/06/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,50	0,48	0,025
XEU Benchmark 3Y	0,77	0,72	0,042
XEU Benchmark 4Y	1,11	1,08	0,033
XEU Benchmark 5Y	1,27	1,23	0,041
XEU Benchmark 6Y	1,08	1,03	0,042
XEU Benchmark 7Y	1,15	1,10	0,049
XEU Benchmark 8Y	1,19	1,14	0,051
XEU Benchmark 9Y	1,24	1,19	0,057
XEU Benchmark 10Y	1,33	1,27	0,057
XEU Benchmark 12Y	1,99	1,94	0,048
XEU Benchmark 15Y	1,51	1,45	0,057
XEU Benchmark 20Y	1,52	1,46	0,058
TEC 30	2,35	2,30	0,050





EURIBOR3M							
EURIBOR 3M EUR	-0,328						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	07/06/2022	06/06/2022	TAUX		Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
I JUN22	100,245	100,24	-0,245		100,490	-0,240	0,083
I SEP22	99,52	99,525	0,480		99,040	0,475	0,808
I DEC22	98,99	98,99	1,010		97,980	1,010	1,338
I MAR23	98,565	98,56	1,435		97,130	1,440	1,763
I JUN23	98,27	98,26	1,730		96,540	1,740	2,058
I SEP23	98,095	98,085	1,905		96,190	1,915	2,233
I DEC23	98,025	98,01	1,975		96,050	1,990	2,303
I MAR24	98,02	98,005	1,980		96,040	1,995	2,308
I JUN24	98,05	98,04	1,950		96,100	1,960	2,278
I SEP24	98,07	98,06	1,930		96,140	1,940	2,258
I DEC24	98,085	98,075	1,915		96,170	1,925	2,243
I MAR25	98,08	98,075	1,920		96,160	1,925	2,248

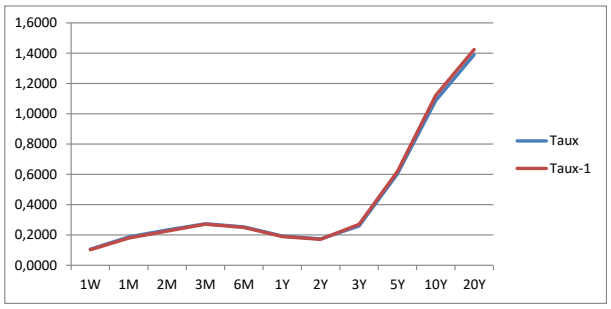


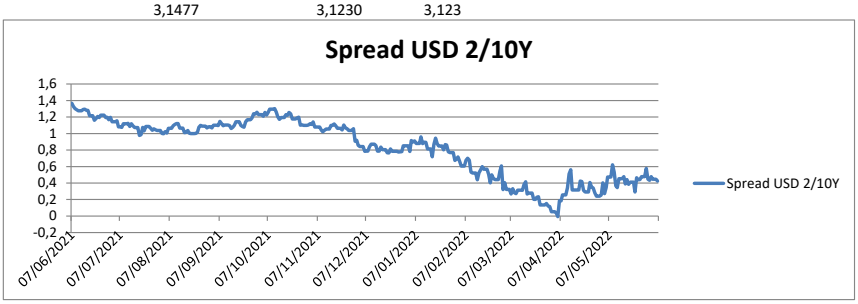
Sensitivity: C2 Internal

TAUX US EMPRUNTEUR

	06/06/2022	02/06/2022	Δ
SOFR	0,7800	0,7900	0,790
SOFR 30 Day	0,7849	0,7529	0,753
SOFR 90 Day	0,4405	0,4079	0,408
SOFR 180 Day	0,2449	0,2286	0,229

	06/06/2022	03/06/2022	
USA Benchmark 1Y	2,0573	2,0083	2,008
US Benchmark 2Y	2,6022	2,5392	2,539
US Benchmark 3Y	2,8827	3,0373	3,037
US Benchmark 5Y	3,0508	2,9722	2,972
US Benchmark 10Y	3,0255	2,9848	2,985
US Benchmark 20Y	3,4403	3,3705	3,371
US Benchmark 30Y	3,1477	3,1230	3,123

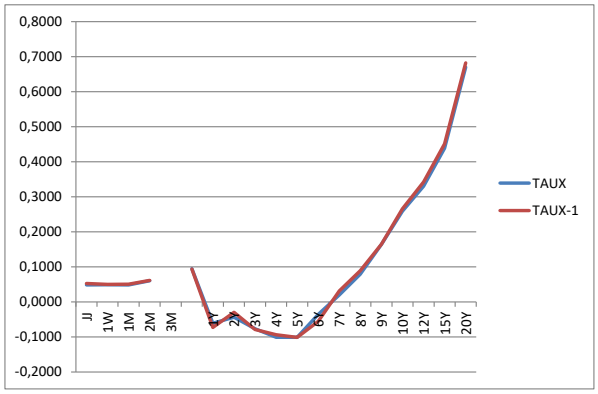


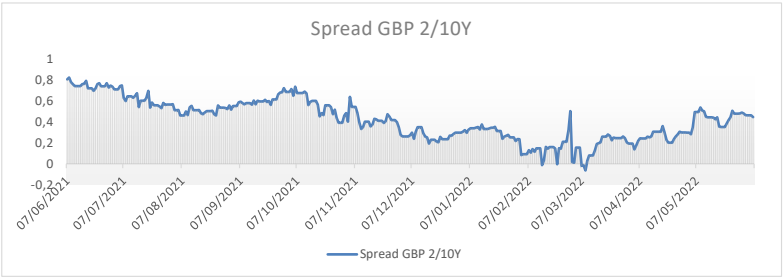


TAUX UK EMPRUNTEUR

	31/05/2022	30/05/2022	Δ
SONIA	0,9410	0,9384	0,9384
LIBOR 1M GBP Synth	1,1248	1,1226	1,1226
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,4184	1,4247	1,4247
LIBOR 6M/ GBP Synt	1,8742	1,8710	1,871

	06/06/2022	03/06/2022	
UK Benchmark 1Y	1,3761	2,4699	2,469895
UK Benchmark 2Y	1,8301	1,7191	1,719053
UK Benchmark 3Y	1,9836	1,8406	1,840569
UK Benchmark 4Y	1,7782	1,6880	1,688044
UK Benchmark 5Y	1,9367	1,8268	1,826753
UK Benchmark 6Y	1,9110	1,8303	1,830314
UK Benchmark 7Y	2,0868	1,9690	1,968994
UK Benchmark 8Y	2,0466	1,9411	1,941109
UK Benchmark 9Y	2,2002	2,1285	2,12854
UK Benchmark 10Y	2,2770	2,1825	2,182524
UK Benchmark 12Y	2,4095	2,3421	2,342082
UK Benchmark 15Y	2,4600	2,3952	2,395153
UK Benchmark 20Y	2,5480	2,5000	2,499985





Sensitivity: C2 Internal