21/06/2022

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	3,24%	3,23%	3,29	-0,050
DE Benchmark 10Y	1,75%	1,74%	1,72	0,026
FR Benchmark 10Y	2,31%	2,30%	2,30	0,0097
FR Benchmark 5Y	1,81%	1,80%	1,80	0,015
UK Benchmark 10Y	2,60%	2,60%	2,59	0,015
TEC 10	2,19			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	109,93	107,99
Petrole Brut Baril	115,12	114,13
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,4825	4,4596
Gaz naturel	6,695	6,944
Or 1 Oc	1834,84	1838,8

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,055	1,0546
EUR/JPY	142,63	142,58
EUR/GBP	0,85806	0,858
EUR/CAD	1,3641	1,3601
EUR/CNY	7,06536	7,05793
EUR/BRL	5,47644	5,46981

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	21,41	21,54	13,43	13,64
3 mois	67,03	67,34	40,9	41,43
6 mois	141,3	142,43	85,17	86,78

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE 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	-0,47	-0,17
Deposit EUR 6M	0,06	0,36
Deposit EUR 12M	0,78	1,08

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,581	20/06/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,568	17/06/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,487	17/06/2022
EURIBOR 3M EUR	-0,169	17/06/2022
EURIBOR 6M EUR	0,291	17/06/2022
EURIBOR 12M EUR	1,124	17/06/2022

	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		
I SEP22	99,255	99,26
I DEC22	98,515	98,52
I MAR23	97,975	97,98
I JUN23	97,69	97,695

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,595	-0,554
OIS EUR 3M	-0,328	-0,287
OIS EUR 6M	0,11	0,151
OIS EUR 1Y	0,836	0,877
OIS EUR 2Y	1,518	1,559
OIS EUR 3Y	1,737	1,778

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,13	0,15
FRA EUR 2x5	0,434	0,454
FRA EUR 3x6	0,754	0,774
FRA EUR 6x9	1,492	1,512
FRA EUR 9x12	2,043	2,063
FRA EUR 3x9	1,144	1,164
FRA EUR 6x12	1,817	1,837
FRA EUR 9x15	2,223	2,243
FRA EUR 12x24	2,54	2,56

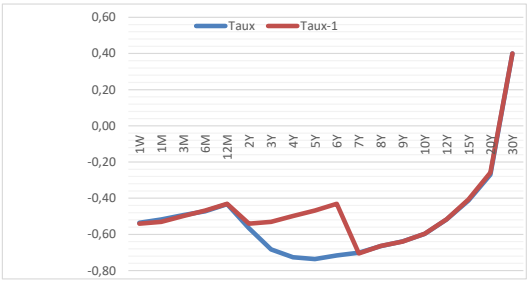
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M Fl	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M Fl	-0,511	-0,491

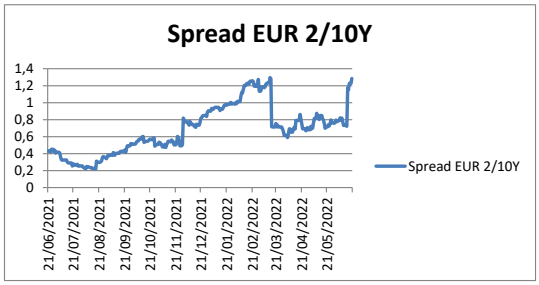
Sensitivity: C2 Internal

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

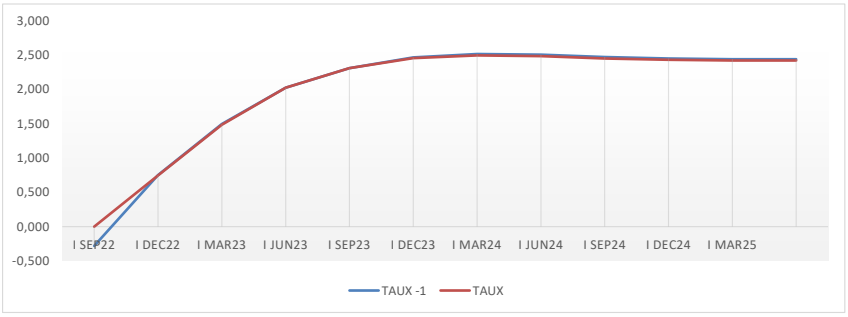
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,031	1,071
IRS EUR 2Y	1,74	1,78
IRS EUR 3Y	1,965	2,005
IRS EUR 4Y	2,087	2,127
IRS EUR 5Y	2,178	2,218
IRS EUR 6Y	2,229	2,269
IRS EUR 7Y	2,283	2,323
IRS EUR 10Y	2,456	2,496

TAUX EURIBOR	17/06/2022	16/06/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,57	-0,57	0,003
EURIBOR 1M EUR	-0,49	-0,50	0,011
EURIBOR 3M EUR	-0,17	-0,17	0,003
EURIBOR 6M EUR	0,29	0,25	0,042
EURIBOR 12M EUR	1,12	1,06	0,066
	20/06/2022	17/06/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,04	0,98	0,058
XEU Benchmark 3Y	1,28	1,20	0,078
XEU Benchmark 4Y	1,68	1,61	0,074
XEU Benchmark 5Y	1,82	1,72	0,094
XEU Benchmark 6Y	1,60	1,50	0,107
XEU Benchmark 7Y	1,61	1,50	0,106
XEU Benchmark 8Y	1,64	1,54	0,100
XEU Benchmark 9Y	2,17	2,06	0,117
XEU Benchmark 10Y	2,32	2,21	0,115
XEU Benchmark 12Y	2,46	2,34	0,125
XEU Benchmark 15Y	1,94	1,82	0,114
XEU Benchmark 20Y	1,93	1,82	0,105
TEC 30	2,63	2,60	0,030





EURIBOR3M							
EURIBOR 3M EUR	-0,169						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	13/06/2022	13/06/2022	TAUX	Δ		TAUX VEILLE	Δ/FIX
I JUN22		100,281	#VALEUR!	#VALEUR!		-0,281	#VALEUR!
I SEP22	99,255	99,25	0,745		98,510	0,750	0,914
I DEC22	98,515	98,505	1,485		97,030	1,495	1,654
I MAR23	97,975	97,975	2,025		95,950	2,025	2,194
I JUN23	97,69	97,69	2,310		95,380	2,310	2,479
I SEP23	97,545	97,535	2,455		95,090	2,465	2,624
I DEC23	97,505	97,485	2,495		95,010	2,515	2,664
I MAR24	97,515	97,495	2,485		95,030	2,505	2,654
I JUN24	97,55	97,53	2,450		95,100	2,470	2,619
I SEP24	97,57	97,55	2,430		95,140	2,450	2,599
I DEC24	97,58	97,56	2,420		95,160	2,440	2,589
I MAR25	97,58	97,56	2,420		95,160	2,440	2,589

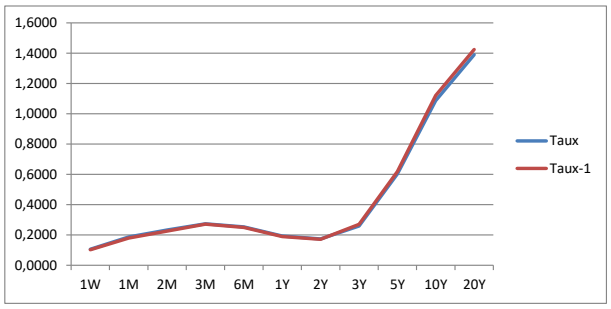


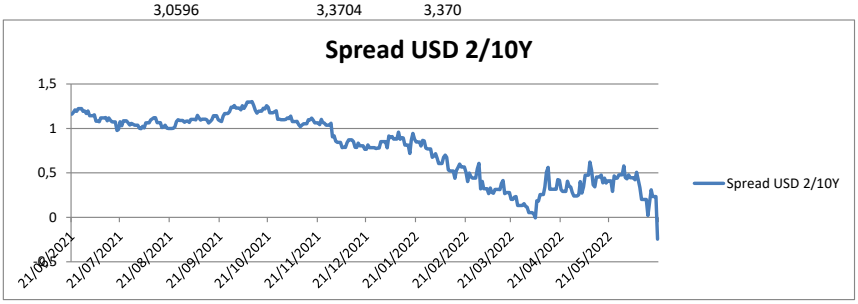
Sensitivity: C2 Internal

TAUX US EMPRUNTEUR

	17/06/2022	15/06/2022	Δ
SOFR	1,4500	0,7000	0,700
SOFR 30 Day	0,7922	0,7739	0,774
SOFR 90 Day	0,5276	0,5103	0,510
SOFR 180 Day	0,2913	0,2799	0,280

	20/06/2022	17/06/2022	
USA Benchmark 1Y	2,6957	2,6657	2,666
US Benchmark 2Y	3,1808	3,1282	3,128
US Benchmark 3Y	3,4018	3,3756	3,376
US Benchmark 5Y	3,3882	3,3794	3,379
US Benchmark 10Y	2,9352	3,3625	3,363
US Benchmark 20Y	3,5678	3,5714	3,571
US Benchmark 30Y	3,0596	3,3704	3,370

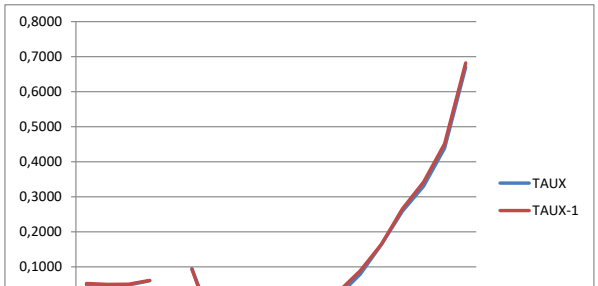


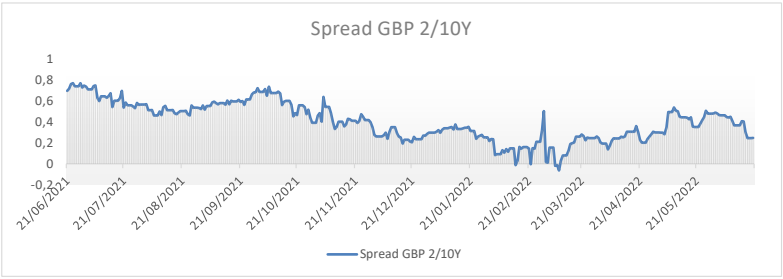


TAUX UK EMPRUNTEUR

	15/06/2022	14/06/2022	Δ
SONIA	0,9399	0,9398	0,9398
LIBOR 1M GBP Synth	1,2308	1,3077	1,3077
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,6040	1,6165	1,6165
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,2834	2,1892	2,1892

	20/06/2022	17/06/2022	
UK Benchmark 1Y	2,1195	2,0424	2,042376
UK Benchmark 2Y	2,3920	2,2955	2,295523
UK Benchmark 3Y	2,4737	2,4004	2,400446
UK Benchmark 4Y	2,3932	2,3052	2,3052
UK Benchmark 5Y	2,3217	2,2330	2,233025
UK Benchmark 6Y	2,3654	2,2733	2,273256
UK Benchmark 7Y	2,4721	2,3874	2,387408
UK Benchmark 8Y	2,4738	2,3875	2,387538
UK Benchmark 9Y	2,5120	2,4959	2,495949
UK Benchmark 10Y	2,6394	2,5409	2,540894
UK Benchmark 12Y	2,7868	2,6860	2,685976
UK Benchmark 15Y	2,8551	2,7319	2,731941
UK Benchmark 20Y	2,8906	2,7651	2,765092





Sensitivity: C2 Internal