

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,76%	2,75%	2,79	-0,026
DE Benchmark 10Y	1,03%	1,02%	1,03	-0,004
FR Benchmark 10Y	1,61%	1,60%	1,62	-0,0081
FR Benchmark 5Y	1,15%	1,14%	1,16	-0,015
UK Benchmark 10Y	1,94%	1,93%	1,94	0,005
TEC 10	1,57			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	93,53	94,7
Petrole Brut Baril	102,14	103,2
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,4236	3,4556
Gaz naturel	8,372	8,299
Or 1 Oc	1728,11	1727,4

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0199	1,0196
EUR/JPY	138,996	138,97
EUR/GBP	0,8505	0,85014
EUR/CAD	1,3176	1,31719
EUR/CNY	6,8893	6,88165
EUR/BRL	5,60794	5,60126

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	23,65	23,74	13,15	13,33
3 mois	68,45	68,66	37,64	38,09
6 mois	147,27	148,12	78,34	80,07

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,73	-0,43
Deposit EUR 1M	-0,26	0,04
Deposit EUR 2M	-0,19	0,11
Deposit EUR 3M	0,05	0,35
Deposit EUR 6M	0,44	0,74
Deposit EUR 12M	0,83	1,13

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,582	22/07/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,421	22/07/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,17	22/07/2022
EURIBOR 3M EUR	0,2	22/07/2022
EURIBOR 6M EUR	0,706	22/07/2022
EURIBOR 12M EUR	1,2	22/07/2022

	30/06/2022	31/05/2022
TMO	2,28	1,76
TME	2,08	1,56
TMM	-0,4971	-0,5001
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,526	-0,545
EURIBOR 3M MOY MENS	-0,243	-0,387

## COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I SEP22	99,225	99,23
I DEC22	98,745	98,75
I MAR23	98,645	98,65
I JUN23	98,61	98,615
I DEC23	98,595	98,6

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,11	-0,069
OIS EUR 3M	0,115	0,156
OIS EUR 6M	0,473	0,514
OIS EUR 1Y	0,78	0,821
OIS EUR 2Y	0,969	1,01
OIS EUR 3Y	1,044	1,085

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,538	0,558
FRA EUR 2x5	0,816	0,836
FRA EUR 3x6	1,016	1,036
FRA EUR 6x9	1,246	1,266
FRA EUR 9x12	1,323	1,343
FRA EUR 3x9	1,157	1,177
FRA EUR 6x12	1,363	1,383
FRA EUR 9x15	1,421	1,441
FRA EUR 12x24	1,337	1,357

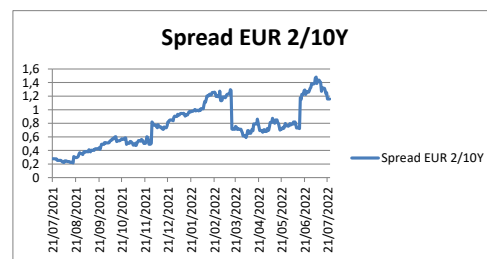
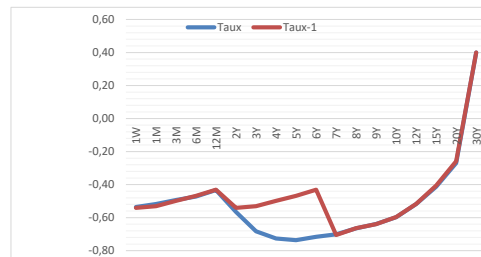
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

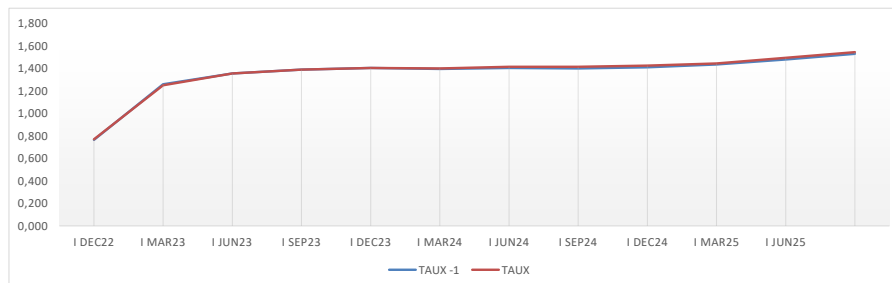
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,952	0,992
IRS EUR 2Y	1,186	1,226
IRS EUR 3Y	1,271	1,311
IRS EUR 4Y	1,37	1,41
IRS EUR 5Y	1,473	1,513
IRS EUR 6Y	1,551	1,591
IRS EUR 7Y	1,621	1,661
IRS EUR 10Y	1,824	1,864



TAUX EURIBOR	22/07/2022	21/07/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,42	-0,51	0,092
EURIBOR 1M EUR	-0,17	-0,25	0,082
EURIBOR 3M EUR	0,20	0,15	0,055
EURIBOR 6M EUR	0,71	0,63	0,074
EURIBOR 12M EUR	1,20	1,14	0,058
	22/07/2022	21/07/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,34	0,57	-0,227
XEU Benchmark 3Y	0,46	0,70	-0,240
XEU Benchmark 4Y	0,87	1,12	-0,257
XEU Benchmark 5Y	1,00	1,26	-0,262
XEU Benchmark 6Y	0,77	1,00	-0,233
XEU Benchmark 7Y	0,79	1,02	-0,228
XEU Benchmark 8Y	0,84	1,05	-0,215
XEU Benchmark 9Y	1,40	1,57	-0,167
XEU Benchmark 10Y	1,55	1,72	-0,172
XEU Benchmark 12Y	1,76	1,95	-0,186
XEU Benchmark 15Y	1,21	1,38	-0,165
XEU Benchmark 20Y	1,25	1,39	-0,143
TEC 30	2,19	2,37	-0,180

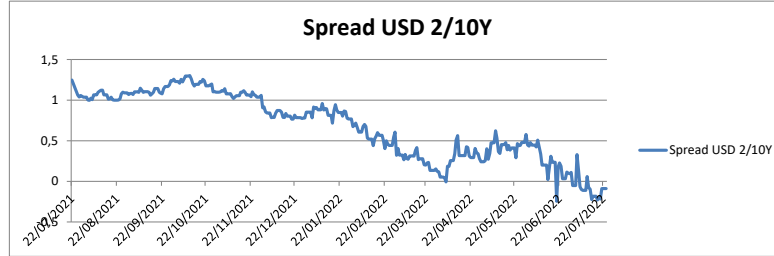
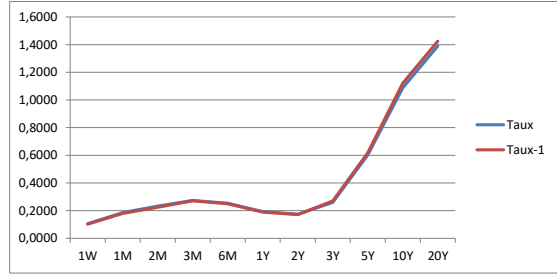


EURIBOR3M	0,2							
EURIBOR 3M EUR	0,2							
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	25/07/2022	22/07/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX		
I SEP22	99,23	99,235	0,770		98,460	0,765	0,570	
I DEC22	98,75	98,74	1,250		97,500	1,260	1,050	
I MAR23	98,645	98,645	1,355		97,290	1,355	1,155	
I JUN23	98,61	98,61	1,390		97,220	1,390	1,190	
I SEP23	98,595	98,595	1,405		97,190	1,405	1,205	
I DEC23	98,6	98,605	1,400		97,200	1,395	1,200	
I MAR24	98,585	98,595	1,415		97,170	1,405	1,215	
I JUN24	98,585	98,6	1,415		97,170	1,400	1,215	
I SEP24	98,575	98,59	1,425		97,150	1,410	1,225	
I DEC24	98,555	98,565	1,445		97,110	1,435	1,245	
I MAR25	98,505	98,52	1,495		97,010	1,480	1,295	
I JUN25	98,455	98,47	1,545		96,910	1,530	1,345	



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	22/07/2022	20/07/2022	Δ
SOFR	1,5300	1,5300	1,530
SOFR 30 Day	1,5169	1,5116	1,512
SOFR 90 Day	1,0023	0,9742	0,974
SOFR 180 Day	0,5752	0,5587	0,559
	<b>22/07/2022</b>	<b>21/07/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	3,0943	3,1986	3,199
US Benchmark 2Y	2,9838	3,1681	3,168
US Benchmark 3Y	3,0296	3,2183	3,218
US Benchmark 5Y	2,9988	3,2520	3,252
US Benchmark 10Y	2,8606	3,0802	3,080
US Benchmark 20Y	3,2292	3,3491	3,349
US Benchmark 30Y	3,0008	3,0746	3,075



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	21/07/2022	20/07/2022	Δ
SONIA	1,1901	1,1906	1,1906
LIBOR 1M GBP Synth	1,4852	1,4825	1,4825
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,8899	1,9005	1,9005
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,4539	2,5254	2,5254
	<b>22/07/2022</b>	<b>21/07/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	1,8672	2,0379	2,037866
UK Benchmark 2Y	2,0732	2,2648	2,26484
UK Benchmark 3Y	1,9566	2,1165	2,116493
UK Benchmark 4Y	1,8116	1,9576	1,957594
UK Benchmark 5Y	1,7223	1,8533	1,853345
UK Benchmark 6Y	1,7084	1,8760	1,876014
UK Benchmark 7Y	1,8152	1,9639	1,963917
UK Benchmark 8Y	1,8318	1,9718	1,971842
UK Benchmark 9Y	1,9686	2,1590	2,159013
UK Benchmark 10Y	2,0057	2,1291	2,129085
UK Benchmark 12Y	2,2431	2,3863	2,38628
UK Benchmark 15Y	2,4559	2,5443	2,544328
UK Benchmark 20Y	2,5094	2,6273	2,627337

