

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,65%	2,65%	2,66	-0,014
DE Benchmark 10Y	0,81%	0,81%	0,85	-0,035
FR Benchmark 10Y	1,39%	1,38%	1,41	-0,0234
FR Benchmark 5Y	0,90%	0,89%	0,93	-0,027
UK Benchmark 10Y	1,86%	1,85%	1,90	-0,034
TEC 10	1,4			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	97,59	98,62
Petrole Brut Baril	103,53	103,97
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,4975	3,549
Gaz naturel	7,942	8,229
Or 1 Oc	1764,4595	1766,25

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,02326	1,02315
EUR/JPY	135,496	135,485
EUR/GBP	0,83894	0,83889
EUR/CAD	1,30878	1,3086
EUR/CNY	6,91022	6,90299
EUR/BRL	5,29932	5,29299

P't de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	23,86	23,95	13,33	13,48
3 mois	67,32	67,53	36,77	37,12
6 mois	147,63	148,48	78,03	79,39

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,28	0,02
Deposit EUR 1M	-0,21	0,09
Deposit EUR 2M	-0,11	0,19
Deposit EUR 3M		0,3
Deposit EUR 6M	0,39	0,69
Deposit EUR 12M	0,66	0,96

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,091	29/07/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,074	29/07/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,035	28/07/2022
EURIBOR 3M EUR	0,232	29/07/2022
EURIBOR 6M EUR	0,653	29/07/2022
EURIBOR 12M EUR	0,921	29/07/2022

	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	99,31	99,315
I DEC22	98,885	98,89
I MAR23	98,775	98,78
I JUN23	98,73	98,74
I DEC23	98,74	98,745

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,11	-0,069
OIS EUR 3M	0,14	0,181
OIS EUR 6M	0,453	0,494
OIS EUR 1Y	0,723	0,764
OIS EUR 2Y	0,873	0,914
OIS EUR 3Y	0,927	0,968

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,533	0,553
FRA EUR 2x5	0,75	0,77
FRA EUR 3x6	0,93	0,95
FRA EUR 6x9	1,185	1,205
FRA EUR 9x12	1,261	1,281
FRA EUR 3x9	1,083	1,103
FRA EUR 6x12	1,295	1,315
FRA EUR 9x15	1,327	1,347
FRA EUR 12x24	1,438	1,458

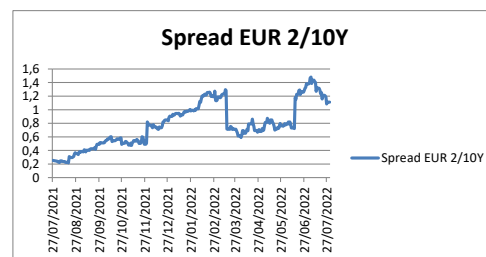
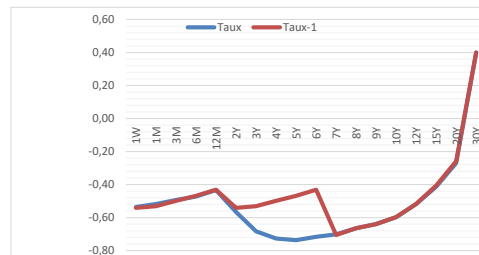
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

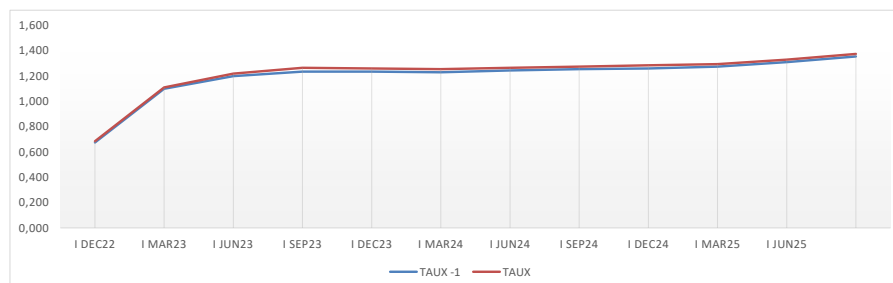
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	0,902	0,942
IRS EUR 2Y	1,092	1,132
IRS EUR 3Y	1,16	1,2
IRS EUR 4Y	1,24	1,28
IRS EUR 5Y	1,324	1,364
IRS EUR 6Y	1,401	1,441
IRS EUR 7Y	1,473	1,513
IRS EUR 10Y	1,68	1,72



TAUX EURIBOR	29/07/2022	28/07/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,07	-0,08	0,007
EURIBOR 1M EUR	-0,04	-0,06	0,027
EURIBOR 3M EUR	0,23	0,27	-0,035
EURIBOR 6M EUR	0,65	0,66	-0,007
EURIBOR 12M EUR	0,92	1,04	-0,123
	29/07/2022	28/07/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,20	0,20	0,004
XEU Benchmark 3Y	0,30	0,29	0,004
XEU Benchmark 4Y	0,65	0,62	0,027
XEU Benchmark 5Y	0,75	0,73	0,027
XEU Benchmark 6Y	0,55	0,55	-0,003
XEU Benchmark 7Y	0,57	0,58	-0,005
XEU Benchmark 8Y	0,62	0,63	-0,005
XEU Benchmark 9Y	1,15	1,15	-0,007
XEU Benchmark 10Y	1,30	1,31	-0,010
XEU Benchmark 12Y	1,52	1,53	-0,002
XEU Benchmark 15Y	1,00	1,02	-0,018
XEU Benchmark 20Y	1,04	1,06	-0,027
TEC 30	2,06	2,18	-0,120

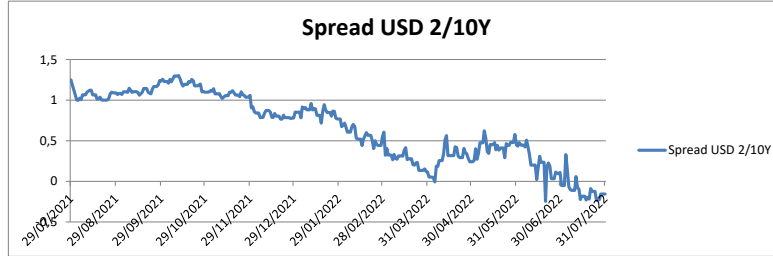
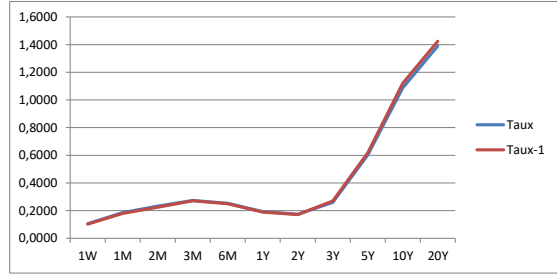


EURIBOR3M	0,232						
EURIBOR 3M EUR	0,232						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
	01/08/2022	29/07/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I SEP22	99,315	99,325	0,685		98,630	0,675	0,453
I DEC22	98,89	98,9	1,110		97,780	1,100	0,878
I MAR23	98,78	98,8	1,220		97,560	1,200	0,988
I JUN23	98,735	98,765	1,265		97,470	1,235	1,033
I SEP23	98,74	98,765	1,260		97,480	1,235	1,028
I DEC23	98,745	98,77	1,255		97,490	1,230	1,023
I MAR24	98,735	98,755	1,265		97,470	1,245	1,033
I JUN24	98,725	98,745	1,275		97,450	1,255	1,043
I SEP24	98,715	98,74	1,285		97,430	1,260	1,053
I DEC24	98,705	98,725	1,295		97,410	1,275	1,063
I MAR25	98,67	98,69	1,330		97,340	1,310	1,098
I JUN25	98,625	98,645	1,375		97,250	1,355	1,143



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	29/07/2022	27/07/2022	Δ
SOFR	2,2800	1,5300	1,530
SOFR 30 Day	1,5549	1,5286	1,529
SOFR 90 Day	1,1083	1,0721	1,072
SOFR 180 Day	0,6371	0,6164	0,616
	<b>29/07/2022</b>	<b>28/07/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	3,0458	3,0560	3,056
US Benchmark 2Y	2,9377	2,9089	2,909
US Benchmark 3Y	2,9224	2,9216	2,922
US Benchmark 5Y	2,7646	2,9144	2,914
US Benchmark 10Y	2,7226	2,7517	2,752
US Benchmark 20Y	3,1963	3,2182	3,218
US Benchmark 30Y	3,0123	2,9905	2,990



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	28/07/2022	27/07/2022	Δ
SONIA	1,1909	1,1909	1,1909
LIBOR 1M GBP Synth	1,5794	1,5912	1,5912
LIBOR 3M/ GBP Synt	1,9357	1,9473	1,9473
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,4597	2,5023	2,5023
	<b>29/07/2022</b>	<b>28/07/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	1,8636	1,9985	1,998524
UK Benchmark 2Y	1,9682	1,9437	1,943732
UK Benchmark 3Y	1,8865	1,8336	1,833608
UK Benchmark 4Y	1,7244	1,7004	1,700398
UK Benchmark 5Y	1,6191	1,5986	1,598574
UK Benchmark 6Y	1,6364	1,6155	1,615464
UK Benchmark 7Y	1,7664	1,7401	1,740063
UK Benchmark 8Y	1,7936	1,7538	1,753757
UK Benchmark 9Y	1,9131	1,9859	1,985865
UK Benchmark 10Y	1,9711	1,9247	1,924744
UK Benchmark 12Y	2,1717	2,1437	2,143685
UK Benchmark 15Y	2,3543	2,3749	2,374896
UK Benchmark 20Y	2,4839	2,4704	2,470357

