

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,83%	2,83%	2,80	0,032
DE Benchmark 10Y	0,96%	0,95%	0,89	0,064
FR Benchmark 10Y	1,50%	1,49%	1,44	0,0547
FR Benchmark 5Y	1,06%	1,05%	1,01	0,053
UK Benchmark 10Y	2,05%	2,04%	1,97	0,082
TEC 10	1,28			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	88,46	89,01
Petrole Brut Baril	94,33	94,92
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,1903	3,2159
Gaz naturel	7,864	8,064
Or 1 Oc	1772,965	1775,1

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0189	1,0185
EUR/JPY	137,714	137,707
EUR/GBP	0,84318	0,84309
EUR/CAD	1,3168	1,3128
EUR/CNY	6,89198	6,88477
EUR/BRL	5,265	5,25806

P't de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	22,95	23,05	13,48	13,63
3 mois	67,75	67,96	37,88	38,24
6 mois	150,5	151,35	80,88	82,25

MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,23	0,07
Deposit EUR 1M	-0,2	0,1
Deposit EUR 2M		0,3
Deposit EUR 3M	0,12	0,42
Deposit EUR 6M	0,44	0,74
Deposit EUR 12M	0,72	1,02

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,085	05/08/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,07	05/08/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,041	05/08/2022
EURIBOR 3M EUR	0,277	05/08/2022
EURIBOR 6M EUR	0,678	05/08/2022
EURIBOR 12M EUR	1,023	05/08/2022

	31/07/2022	30/06/2022
TMO	1,95	2,28
TME	1,75	2,08
TMM	-0,4166	-0,4971
EURIBOR 1M MOY MENS	-0,304	-0,526
EURIBOR 3M MOY MENS	0,04	-0,243

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I SEP22	99,29	99,295
I DEC22	98,815	98,82
I MAR23	98,635	98,64
I JUN23	98,56	98,565
I DEC23	98,57	98,575

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	-0,11	-0,069
OIS EUR 3M	0,215	0,256
OIS EUR 6M	0,541	0,582
OIS EUR 1Y	0,848	0,889
OIS EUR 2Y	1,03	1,071
OIS EUR 3Y	1,081	1,122

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,609	0,629
FRA EUR 2x5	0,815	0,835
FRA EUR 3x6	1,04	1,06
FRA EUR 6x9	1,297	1,317
FRA EUR 9x12	1,415	1,435
FRA EUR 3x9	1,198	1,218
FRA EUR 6x12	1,445	1,465
FRA EUR 9x15	1,508	1,528
FRA EUR 12x24	1,615	1,635

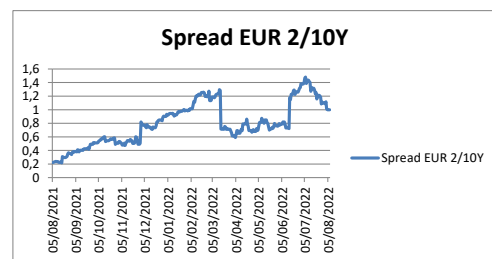
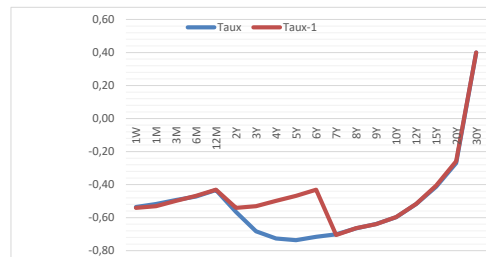
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

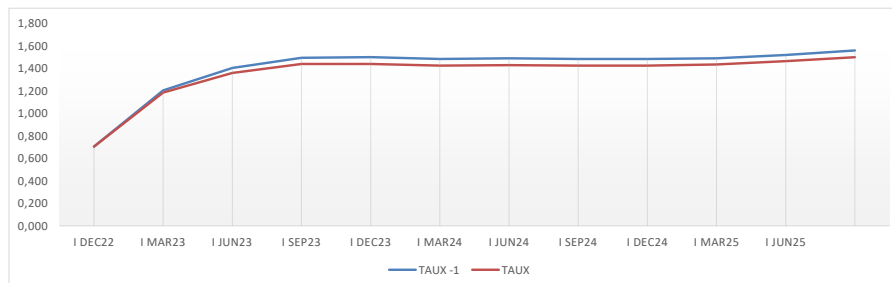
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,01	1,05
IRS EUR 2Y	1,234	1,274
IRS EUR 3Y	1,305	1,345
IRS EUR 4Y	1,369	1,409
IRS EUR 5Y	1,437	1,477
IRS EUR 6Y	1,503	1,543
IRS EUR 7Y	1,563	1,603
IRS EUR 10Y	1,738	1,778



TAUX EURIBOR	05/08/2022	04/08/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,07	-0,07	0,000
EURIBOR 1M EUR	-0,04	-0,04	-0,002
EURIBOR 3M EUR	0,28	0,27	0,008
EURIBOR 6M EUR	0,68	0,69	-0,011
EURIBOR 12M EUR	1,02	1,01	0,009
	05/08/2022	04/08/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,35	0,27	0,082
XEU Benchmark 3Y	0,47	0,33	0,140
XEU Benchmark 4Y	0,83	0,69	0,141
XEU Benchmark 5Y	0,92	0,78	0,147
XEU Benchmark 6Y	0,70	0,54	0,160
XEU Benchmark 7Y	0,72	0,56	0,158
XEU Benchmark 8Y	0,76	0,61	0,150
XEU Benchmark 9Y	1,25	1,11	0,143
XEU Benchmark 10Y	1,41	1,26	0,143
XEU Benchmark 12Y	1,63	1,51	0,126
XEU Benchmark 15Y	1,09	0,95	0,139
XEU Benchmark 20Y	1,12	0,99	0,129
TEC 30	1,90	1,94	-0,040

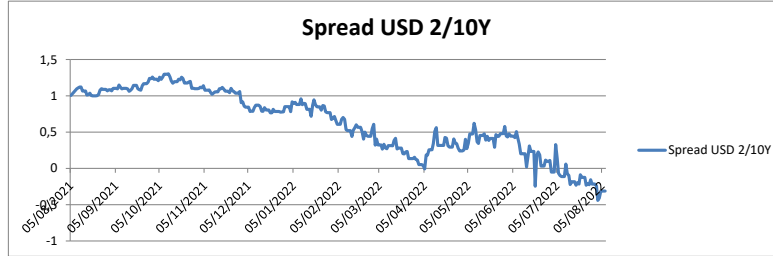
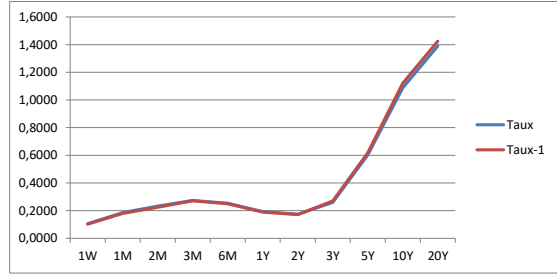


EURIBOR3M	0,277							
EURIBOR 3M EUR	0,277							
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	08/08/2022	05/08/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX		
I SEP22	99,295	99,295	0,705		98,590	0,705	0,428	
I DEC22	98,815	98,795	1,185		97,630	1,205	0,908	
I MAR23	98,64	98,595	1,360		97,280	1,405	1,083	
I JUN23	98,56	98,505	1,440		97,120	1,495	1,163	
I SEP23	98,56	98,5	1,440		97,120	1,500	1,163	
I DEC23	98,575	98,515	1,425		97,150	1,485	1,148	
I MAR24	98,57	98,51	1,430		97,140	1,490	1,153	
I JUN24	98,575	98,515	1,425		97,150	1,485	1,148	
I SEP24	98,575	98,515	1,425		97,150	1,485	1,148	
I DEC24	98,565	98,51	1,435		97,130	1,490	1,158	
I MAR25	98,535	98,48	1,465		97,070	1,520	1,188	
I JUN25	98,5	98,44	1,500		97,000	1,560	1,223	



TAUX US EMPRUNTEUR 

	05/08/2022	03/08/2022	Δ
SOFR	2,2900	2,2900	2,290
SOFR 30 Day	1,7332	1,6824	1,682
SOFR 90 Day	1,2525	1,2189	1,219
SOFR 180 Day	0,7242	0,6992	0,699
	05/08/2022	04/08/2022	
USA Benchmark 1Y	3,2834	3,1537	3,154
US Benchmark 2Y	3,2401	3,0729	3,073
US Benchmark 3Y	3,2572	3,0834	3,083
US Benchmark 5Y	2,8773	2,9245	2,924
US Benchmark 10Y	2,7340	2,7597	2,760
US Benchmark 20Y	3,2975	3,1514	3,151
US Benchmark 30Y	3,0933	2,9550	2,955



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	04/08/2022	03/08/2022	Δ
SONIA	1,6886	1,1911	1,1911
LIBOR 1M GBP Synth	1,7227	1,6730	1,673
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,0781	2,0158	2,0158
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,5941	2,5642	2,5642
	05/08/2022	04/08/2022	
UK Benchmark 1Y	2,0656	2,0542	2,054218
UK Benchmark 2Y	2,1714	2,0249	2,024889
UK Benchmark 3Y	2,0893	1,9535	1,953479
UK Benchmark 4Y	1,9864	1,8266	1,826622
UK Benchmark 5Y	1,8943	1,7280	1,727969
UK Benchmark 6Y	1,8598	1,6998	1,699762
UK Benchmark 7Y	1,9619	1,7853	1,785269
UK Benchmark 8Y	1,9405	1,7640	1,764049
UK Benchmark 9Y	1,9234	1,8870	1,887008
UK Benchmark 10Y	2,0905	1,9168	1,916822
UK Benchmark 12Y	2,2888	2,1067	2,106735
UK Benchmark 15Y	2,4273	2,2670	2,266974
UK Benchmark 20Y	2,4731	2,3203	2,320281

