

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	2,90%	2,90%	2,88	0,016
DE Benchmark 10Y	1,09%	1,08%	1,12	-0,033
FR Benchmark 10Y	1,66%	1,66%	1,70	-0,0376
FR Benchmark 5Y	1,25%	1,24%	1,30	-0,047
UK Benchmark 10Y	2,29%	2,28%	2,31	-0,022
TEC 10	1,56			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	88,02	88,11
Petrole Brut Baril	93,72	93,65
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,6163	3,6174
Gaz naturel	9,257	9,244
Or 1 Oc	1761,85	1761,66

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,016	1,0156
EUR/JPY	137,473	137,465
EUR/GBP	0,84475	0,8447
EUR/CAD	1,31391	1,31371
EUR/CNY	6,90528	6,89808
EUR/BRL	5,2516	5,24579

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	20,08	20,16	12,61	12,75
3 mois	66,09	66,3	39,92	40,27
6 mois	145,21	146,06	90,07	91,44

## MARCHÉ MONÉTAIRE

MARCHÉ MONÉTAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,23	0,07
Deposit EUR 1M	-0,12	0,18
Deposit EUR 2M	0,02	0,32
Deposit EUR 3M	0,17	0,47
Deposit EUR 6M	0,53	0,83
Deposit EUR 12M	0,87	1,17

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,087	17/08/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,071	16/08/2022
EURIBOR 1M EUR	-0,028	16/08/2022
EURIBOR 3M EUR	0,333	16/08/2022
EURIBOR 6M EUR	0,735	16/08/2022
EURIBOR 12M EUR	1,118	16/08/2022

	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	99,275	99,28
I DEC22	98,7	98,705
I MAR23	98,39	98,395
I JUN23	98,215	98,22
I DEC23	98,14	98,145

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,023	0,064
OIS EUR 3M	0,362	0,403
OIS EUR 6M	0,693	0,734
OIS EUR 1Y	1,068	1,109
OIS EUR 2Y	1,334	1,375
OIS EUR 3Y	1,386	1,427

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,747	0,767
FRA EUR 2x5	0,961	0,981
FRA EUR 3x6	1,166	1,186
FRA EUR 6x9	1,514	1,534
FRA EUR 9x12	1,711	1,731
FRA EUR 3x9	1,383	1,403
FRA EUR 6x12	1,713	1,733
FRA EUR 9x15	1,858	1,878
FRA EUR 12x24	2,05	2,07

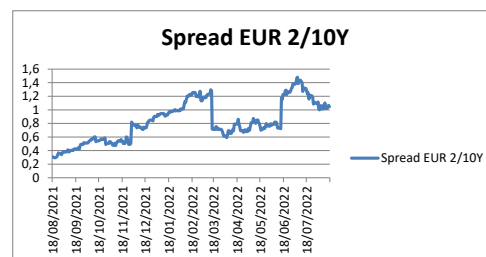
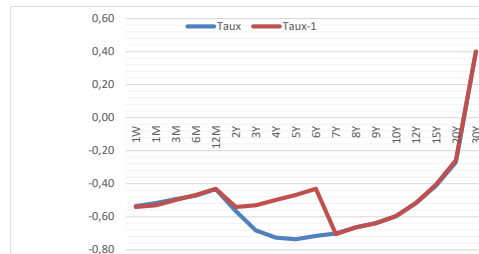
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

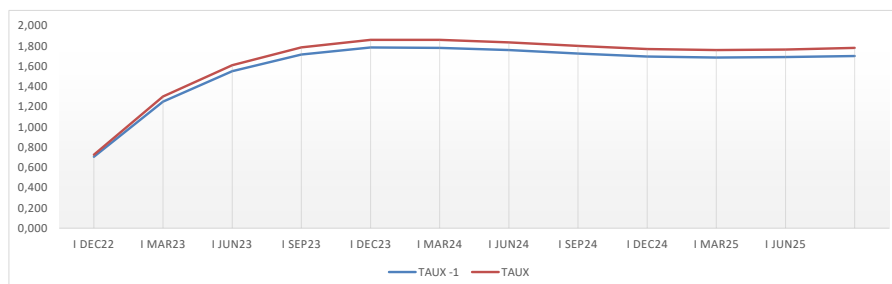
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,191	1,231
IRS EUR 2Y	1,511	1,551
IRS EUR 3Y	1,584	1,624
IRS EUR 4Y	1,629	1,669
IRS EUR 5Y	1,675	1,715
IRS EUR 6Y	1,719	1,759
IRS EUR 7Y	1,762	1,802
IRS EUR 10Y	1,905	1,945



TAUX EURIBOR	16/08/2022	15/08/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,07	-0,07	-0,003
EURIBOR 1M EUR	-0,03	-0,02	-0,012
EURIBOR 3M EUR	0,33	0,34	-0,006
EURIBOR 6M EUR	0,74	0,75	-0,010
EURIBOR 12M EUR	1,12	1,16	-0,040
	17/08/2022	16/08/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,53	0,38	0,149
XEU Benchmark 3Y	0,66	0,51	0,159
XEU Benchmark 4Y	1,03	0,87	0,152
XEU Benchmark 5Y	1,12	0,97	0,150
XEU Benchmark 6Y	0,86	0,72	0,139
XEU Benchmark 7Y	0,87	0,73	0,135
XEU Benchmark 8Y	0,90	0,77	0,126
XEU Benchmark 9Y	1,41	1,28	0,129
XEU Benchmark 10Y	1,57	1,44	0,130
XEU Benchmark 12Y	1,80	1,69	0,112
XEU Benchmark 15Y	1,23	1,13	0,092
XEU Benchmark 20Y	1,24	1,17	0,074
TEC 30	2,18	2,05	0,130

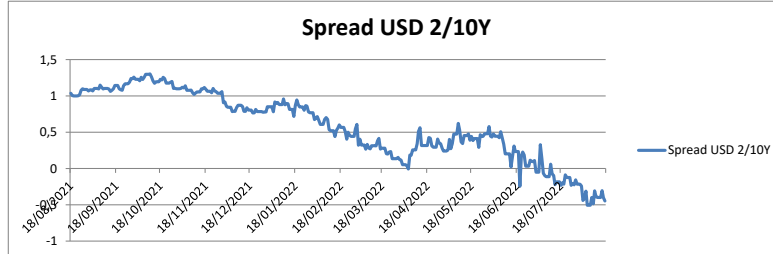
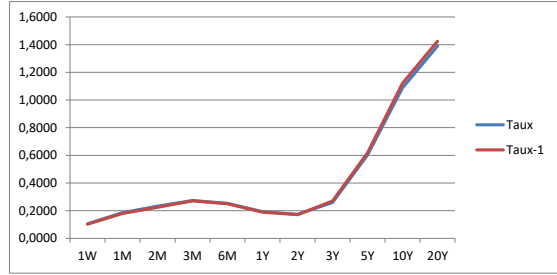


EURIBOR3M	0,333						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	18/08/2022	17/08/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I SEP22	99,275	99,295	0,725		98,550	0,705	0,392
I DEC22	98,7	98,75	1,300		97,400	1,250	0,967
I MAR23	98,39	98,45	1,610		96,780	1,550	1,277
I JUN23	98,215	98,285	1,785		96,430	1,715	1,452
I SEP23	98,14	98,215	1,860		96,280	1,785	1,527
I DEC23	98,14	98,22	1,860		96,280	1,780	1,527
I MAR24	98,165	98,24	1,835		96,330	1,760	1,502
I JUN24	98,2	98,275	1,800		96,400	1,725	1,467
I SEP24	98,23	98,305	1,770		96,460	1,695	1,437
I DEC24	98,24	98,315	1,760		96,480	1,685	1,427
I MAR25	98,235	98,31	1,765		96,470	1,690	1,432
I JUN25	98,22	98,3	1,780		96,440	1,700	1,447



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	17/08/2022	15/08/2022	Δ
SOFR	2,2900	2,2900	2,290
SOFR 30 Day	2,0326	1,9825	1,983
SOFR 90 Day	1,4525	1,4191	1,419
SOFR 180 Day	0,8736	0,8487	0,849
	<b>17/08/2022</b>	<b>16/08/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	3,2967	3,2395	3,240
US Benchmark 2Y	3,3471	3,2347	3,235
US Benchmark 3Y	3,3991	3,2816	3,282
US Benchmark 5Y	3,0816	2,9741	2,974
US Benchmark 10Y	2,8996	2,8334	2,833
US Benchmark 20Y	3,3747	3,3465	3,347
US Benchmark 30Y	3,1674	3,1696	3,170



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	15/08/2022	12/08/2022	Δ
SONIA	1,6895	1,6897	1,6897
LIBOR 1M GBP Synth	1,7376	1,7220	1,722
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,1815	2,1662	2,1662
LIBOR 6M/ GBP Synt	2,7514	2,7265	2,7265
	<b>17/08/2022</b>	<b>16/08/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	2,5577	2,3814	2,38144
UK Benchmark 2Y	2,5798	2,3019	2,301918
UK Benchmark 3Y	2,4588	2,2353	2,235252
UK Benchmark 4Y	2,2605	2,0869	2,086928
UK Benchmark 5Y	2,1653	2,0009	2,000928
UK Benchmark 6Y	2,1474	1,9753	1,975328
UK Benchmark 7Y	2,2276	2,0701	2,070099
UK Benchmark 8Y	2,2218	2,0578	2,057821
UK Benchmark 9Y	2,2306	2,0341	2,034061
UK Benchmark 10Y	2,3494	2,2006	2,200619
UK Benchmark 12Y	2,5422	2,3926	2,392619
UK Benchmark 15Y	2,6611	2,5493	2,549276
UK Benchmark 20Y	2,7278	2,6128	2,612781

