

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,06%	3,05%	3,10	-0,047
DE Benchmark 10Y	1,32%	1,31%	1,36	-0,040
FR Benchmark 10Y	1,92%	1,91%	1,98	-0,0627
FR Benchmark 5Y	1,47%	1,46%	1,53	-0,059
UK Benchmark 10Y	2,58%	2,57%	2,69	-0,108
TEC 10	1,84			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	94,76	93,74
Petrole Brut Baril	100,94	100,22
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,9932	3,8419
Gaz naturel	9,238	9,193
Or 1 Oc	1753,45	1748,13

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,998	0,99794
EUR/JPY	136,54	136,532
EUR/GBP	0,84489	0,84482
EUR/CAD	1,29427	1,29412
EUR/CNY	6,84928	6,84294
EUR/BRL	5,0917	5,08658

P't de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	19,5	19,77	12,32	12,74
3 mois	65,75	66,38	40,27	41,36
6 mois	140	142,55	90,76	94,96

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,23	0,07
Deposit EUR 1M	0,02	0,32
Deposit EUR 2M	0,15	0,45
Deposit EUR 3M	0,33	0,63
Deposit EUR 6M	0,72	1,02
Deposit EUR 12M	1,16	1,46

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,08	23/08/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,073	23/08/2022
EURIBOR 1M EUR	0,059	23/08/2022
EURIBOR 3M EUR	0,468	23/08/2022
EURIBOR 6M EUR	0,926	23/08/2022
EURIBOR 12M EUR	1,398	23/08/2022

	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	99,215	99,22
I DEC22	98,565	98,57
I MAR23	98,165	98,17
I JUN23	97,93	97,935
I DEC23	97,825	97,835

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,113	0,154
OIS EUR 3M	0,46	0,501
OIS EUR 6M	0,809	0,85
OIS EUR 1Y	1,25	1,291
OIS EUR 2Y	1,577	1,618
OIS EUR 3Y	1,642	1,683

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	0,803	0,823
FRA EUR 2x5	1,045	1,065
FRA EUR 3x6	1,299	1,319
FRA EUR 6x9	1,738	1,758
FRA EUR 9x12	1,988	2,008
FRA EUR 3x9	1,558	1,578
FRA EUR 6x12	1,946	1,966
FRA EUR 9x15	2,108	2,128
FRA EUR 12x24	2,289	2,309

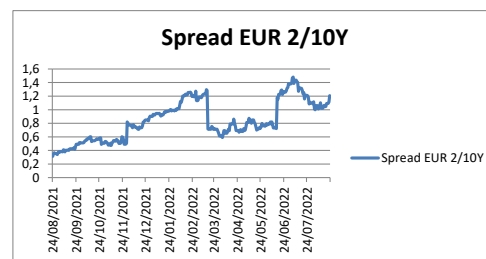
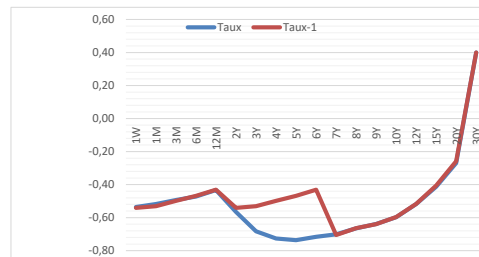
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

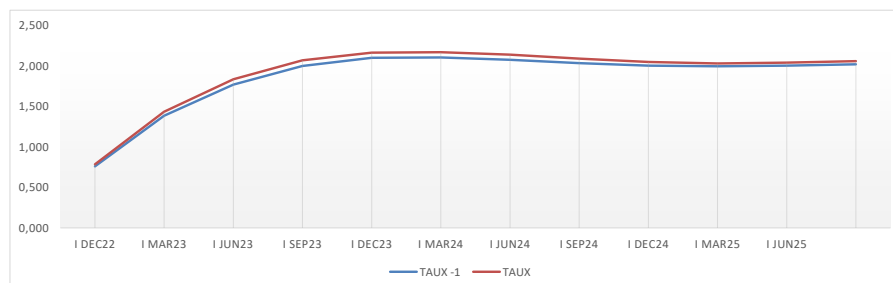
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,381	1,421
IRS EUR 2Y	1,766	1,806
IRS EUR 3Y	1,849	1,889
IRS EUR 4Y	1,909	1,949
IRS EUR 5Y	1,957	1,997
IRS EUR 6Y	2,008	2,048
IRS EUR 7Y	2,058	2,098
IRS EUR 10Y	2,208	2,248



	23/08/2022	22/08/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	-0,07	-0,07	-0,004
EURIBOR 1M EUR	0,06	0,05	0,013
EURIBOR 3M EUR	0,47	0,45	0,015
EURIBOR 6M EUR	0,93	0,91	0,018
EURIBOR 12M EUR	1,40	1,34	0,054
	23/08/2022	22/08/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,66	0,69	-0,036
XEU Benchmark 3Y	0,84	0,87	-0,034
XEU Benchmark 4Y	1,21	1,23	-0,027
XEU Benchmark 5Y	1,33	1,35	-0,020
XEU Benchmark 6Y	1,09	1,10	-0,014
XEU Benchmark 7Y	1,10	1,11	-0,008
XEU Benchmark 8Y	1,14	1,14	0,002
XEU Benchmark 9Y	1,70	1,64	0,057
XEU Benchmark 10Y	1,87	1,81	0,058
XEU Benchmark 12Y	2,05	2,03	0,015
XEU Benchmark 15Y	1,46	1,44	0,025
XEU Benchmark 20Y	1,46	1,43	0,025
TEC 30	2,34	2,25	0,090

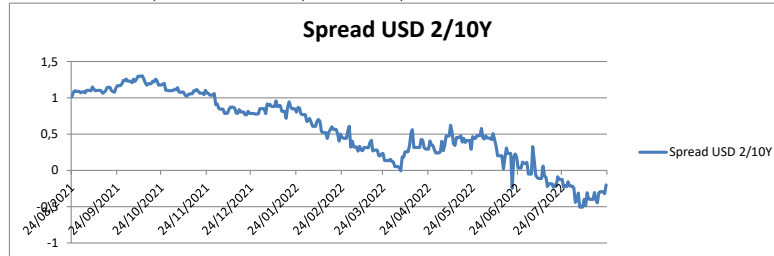
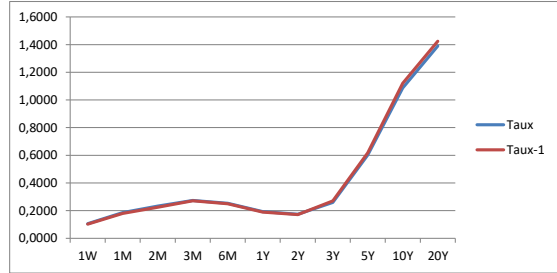


EURIBOR3M	0,468						
EURIBOR 3M EUR	0,468						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	24/08/2022	23/08/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I SEP22	99,215	99,24	0,785		98,430	0,317	
I DEC22	98,565	98,615	1,435		97,130	0,967	
I MAR23	98,165	98,23	1,835		96,330	1,367	
I JUN23	97,93	98	2,070		95,860	1,602	
I SEP23	97,835	97,9	2,165		95,670	1,697	
I DEC23	97,83	97,895	2,170		95,660	1,702	
I MAR24	97,86	97,925	2,140		95,720	1,672	
I JUN24	97,91	97,965	2,090		95,820	1,622	
I SEP24	97,95	97,995	2,050		95,900	1,582	
I DEC24	97,97	98,005	2,030		95,940	1,562	
I MAR25	97,96	97,995	2,040		95,920	1,572	
I JUN25	97,94	97,98	2,060		95,880	1,592	



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	24/08/2022	22/08/2022	Δ
SOFR	2,2700	2,2800	2,280
SOFR 30 Day	2,2082	2,1578	2,158
SOFR 90 Day	1,5694	1,5361	1,536
SOFR 180 Day	0,9608	0,9359	0,936
	<b>23/08/2022</b>	<b>22/08/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	3,2755	3,2791	3,279
US Benchmark 2Y	3,2661	3,3239	3,324
US Benchmark 3Y	3,3682	3,4111	3,411
US Benchmark 5Y	3,2352	3,1541	3,154
US Benchmark 10Y	3,0661	3,0023	3,002
US Benchmark 20Y	3,4544	3,4939	3,494
US Benchmark 30Y	3,2419	3,2752	3,275



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	22/08/2022	19/08/2022	Δ
SONIA	1,6900	1,6901	1,6901
LIBOR 1M GBP Synth	1,8735	1,8512	1,8512
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,3807	2,3482	2,3482
LIBOR 6M/ GBP Synt	3,0716	3,0174	3,0174
	<b>23/08/2022</b>	<b>22/08/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	2,7015	2,6369	2,636867
UK Benchmark 2Y	2,8680	2,7506	2,750602
UK Benchmark 3Y	2,8054	2,6811	2,68109
UK Benchmark 4Y	2,5812	2,4767	2,476696
UK Benchmark 5Y	2,5104	2,3928	2,39281
UK Benchmark 6Y	2,5006	2,3623	2,362324
UK Benchmark 7Y	2,5161	2,4438	2,443792
UK Benchmark 8Y	2,5337	2,4319	2,431933
UK Benchmark 9Y	2,5463	2,3948	2,394814
UK Benchmark 10Y	2,6424	2,5627	2,562691
UK Benchmark 12Y	2,8460	2,7539	2,753884
UK Benchmark 15Y	2,9345	2,8804	2,880365
UK Benchmark 20Y	3,0115	2,9375	2,937499

