07/09/2022

FINANCESCOOP
45 Rue de Naples 75008 Paris
Tél : 01 43 19 75 56

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,35%	3,35%	3,34	0,012
DE Benchmark 10Y	1,64%	1,63%	1,63	0,014
FR Benchmark 10Y	2,20%	2,19%	2,22	-0,0208
FR Benchmark 5Y	1,76%	1,75%	1,76	0,000
UK Benchmark 10Y	3,10%	3,09%	3,09	0,012
TEC 10	2,1			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	85,69	86,88
Petrole Brut Baril	91,73	92,83
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,538	3,5738
Gaz naturel	8,023	8,145
Or 1 Oc	1697,77	1701,51

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,9904	0,99029
EUR/JPY	142,683	142,677
EUR/GBP	0,86161	0,86155
EUR/CAD	1,307	1,30677
EUR/CNY	6,91002	6,90298
EUR/BRL	5,20074	5,19522

Pt de terme
1 mois
3 mois
6 mois

EUR/USD		EUR/GBP	
VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
21,38	21,52	13,74	14,01
62,68	62,94	41,6	42,12
130,17	131,23	89,5	91,49

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	-0,23	0,07
Deposit EUR 1M	0,31	0,61
Deposit EUR 2M	0,43	0,73
Deposit EUR 3M	0,65	0,95
Deposit EUR 6M	1,14	1,44
Deposit EUR 12M	1,62	1,92

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	-0,085	06/09/2022
EURIBOR 1W EUR	-0,073	05/09/2022
EURIBOR 1M EUR	0,298	05/09/2022
EURIBOR 3M EUR	0,783	05/09/2022
EURIBOR 6M EUR	1,298	05/09/2022
EURIBOR 12M EUR	1,874	05/09/2022

	31/08/2022	31/07/2022
TMO	1,83	1,95
TME	1,63	1,75
TMM	0,0004	-0,4166
EURIBOR 1M MOY MENS	0,019	-0,304
EURIBOR 3M MOY MENS	0,395	0,04

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I SEP22	99,04	99,045
I DEC22	98,135	98,14
I MAR23	97,785	97,795
I JUN23	97,625	97,635
I DEC23	97,595	97,6

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,453	0,494
OIS EUR 3M	0,767	0,808
OIS EUR 6M	1,21	1,251
OIS EUR 1Y	1,659	1,7
OIS EUR 2Y	1,905	1,946
OIS EUR 3Y	1,939	1,98

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,192	1,212
FRA EUR 2x5	1,526	1,546
FRA EUR 3x6	1,809	1,829
FRA EUR 6x9	2,16	2,18
FRA EUR 9x12	2,321	2,341
FRA EUR 3x9	2,035	2,055
FRA EUR 6x12	2,355	2,375
FRA EUR 9x15	2,43	2,45
FRA EUR 12x24	2,44	2,46

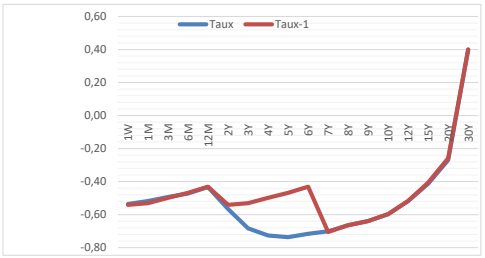
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

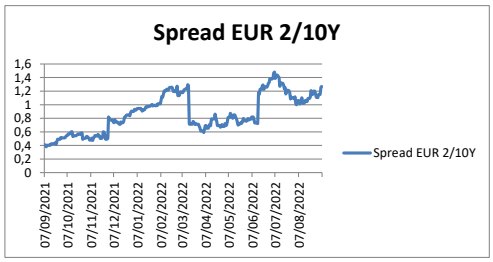
Sensitivity: C2 Internal

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

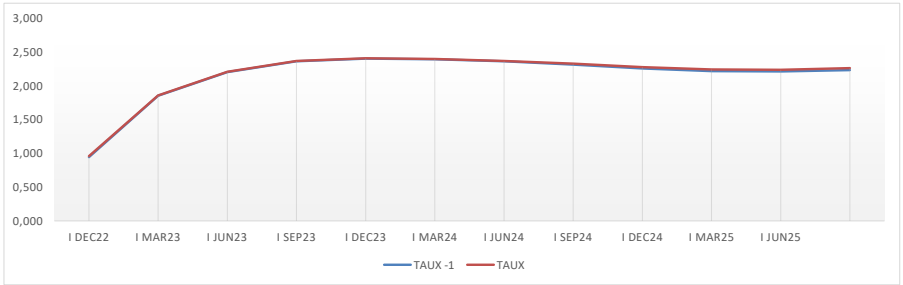
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	1,805	1,845
IRS EUR 2Y	2,102	2,142
IRS EUR 3Y	2,152	2,192
IRS EUR 4Y	2,202	2,242
IRS EUR 5Y	2,26	2,3
IRS EUR 6Y	2,305	2,345
IRS EUR 7Y	2,352	2,392
IRS EUR 10Y	2,508	2,548

TAUX EURIBOR	05/09/2022	02/09/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	-0,07	-0,07	-0,002
EURIBOR 1M EUR	0,30	0,31	-0,016
EURIBOR 3M EUR	0,78	0,76	0,020
EURIBOR 6M EUR	1,30	1,29	0,008
EURIBOR 12M EUR	1,87	1,90	-0,022
	06/09/2022	05/09/2022	
XEU Benchmark 2Y	0,86	0,85	0,005
XEU Benchmark 3Y	1,05	1,05	0,005
XEU Benchmark 4Y	1,49	1,48	0,009
XEU Benchmark 5Y	1,65	1,62	0,028
XEU Benchmark 6Y	1,40	1,35	0,048
XEU Benchmark 7Y	1,41	1,36	0,050
XEU Benchmark 8Y	1,45	1,40	0,057
XEU Benchmark 9Y	1,92	1,90	0,014
XEU Benchmark 10Y	2,13	2,11	0,015
XEU Benchmark 12Y	2,37	2,36	0,002
XEU Benchmark 15Y	1,75	1,70	0,060
XEU Benchmark 20Y	1,73	1,68	0,042
TEC 30	2,57	2,62	-0,050





EURIBOR3M						
EURIBOR 3M EUR	0,783					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	07/09/2022	06/09/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX
I SEP22	99,04	99,055	0,960	98,080	0,945	0,177
I DEC22	98,14	98,145	1,860	96,280	1,855	1,077
I MAR23	97,79	97,795	2,210	95,580	2,205	1,427
I JUN23	97,63	97,635	2,370	95,260	2,365	1,587
I SEP23	97,59	97,595	2,410	95,180	2,405	1,627
I DEC23	97,6	97,605	2,400	95,200	2,395	1,617
I MAR24	97,63	97,635	2,370	95,260	2,365	1,587
I JUN24	97,67	97,685	2,330	95,340	2,315	1,547
I SEP24	97,72	97,74	2,280	95,440	2,260	1,497
I DEC24	97,755	97,78	2,245	95,510	2,220	1,462
I MAR25	97,76	97,785	2,240	95,520	2,215	1,457
I JUN25	97,735	97,765	2,265	95,470	2,235	1,482

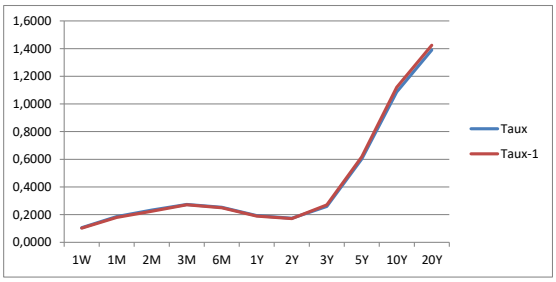


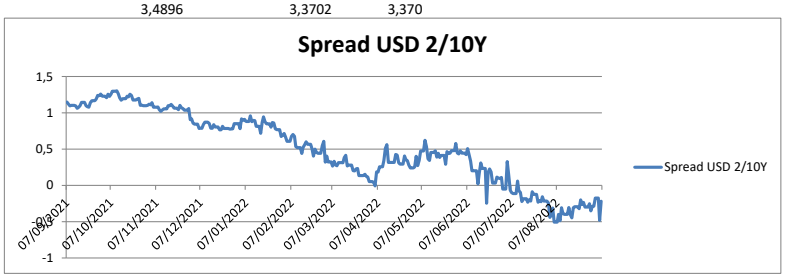
Sensitivity: C2 Internal

TAUX US EMPRUNTEUR

	06/09/2022	01/09/2022	Δ
SOFR	2,2900	2,2900	2,290
SOFR 30 Day	2,2850	2,2847	2,285
SOFR 90 Day	1,7873	1,7030	1,703
SOFR 180 Day	1,1230	1,0604	1,060

	06/09/2022	05/09/2022	
USA Benchmark 1Y	3,5025	3,4346	3,435
US Benchmark 2Y	3,5186	3,4202	3,420
US Benchmark 3Y	3,6301	3,5098	3,510
US Benchmark 5Y	3,4720	3,1511	3,151
US Benchmark 10Y	3,2996	2,9391	2,939
US Benchmark 20Y	3,7348	3,6361	3,636
US Benchmark 30Y	3,4896	3,3702	3,370

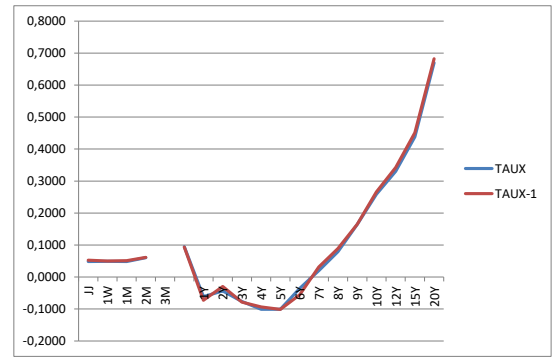


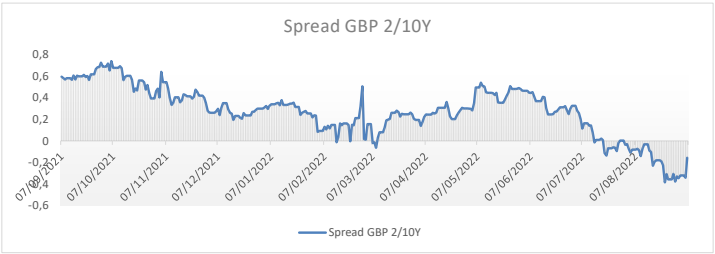


TAUX UK EMPRUNTEUR

	02/09/2022	01/09/2022	Δ
SONIA	1,6911	1,6902	1,6902
LIBOR 1M GBP Synth	2,1813	2,1125	2,1125
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,6744	2,6107	2,6107
LIBOR 6M/ GBP Synt	3,4088	3,3372	3,3372

	06/09/2022	05/09/2022	
UK Benchmark 1Y	2,8350	2,7896	2,789574
UK Benchmark 2Y	3,3109	3,3277	3,327673
UK Benchmark 3Y	3,3009	3,2602	3,260196
UK Benchmark 4Y	3,0497	3,0087	3,008721
UK Benchmark 5Y	3,0030	2,9384	2,938409
UK Benchmark 6Y	2,9936	2,8501	2,850053
UK Benchmark 7Y	3,0718	2,9046	2,904568
UK Benchmark 8Y	3,0077	2,8494	2,849374
UK Benchmark 9Y	2,9952	2,9884	2,98838
UK Benchmark 10Y	3,1548	2,9864	2,986435
UK Benchmark 12Y	3,3434	3,1749	3,174891
UK Benchmark 15Y	3,4497	3,3134	3,313373
UK Benchmark 20Y	3,5046	3,3227	3,322671





Sensitivity: C2 Internal