

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,45%	3,45%	3,45	0,000
DE Benchmark 10Y	1,76%	1,75%	1,79	-0,035
FR Benchmark 10Y	2,32%	2,31%	2,35	-0,0311
FR Benchmark 5Y	2,02%	2,01%	2,04	-0,012
UK Benchmark 10Y	3,14%	3,13%	3,14	0,000
TEC 10	2,29			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	83,62	85,11
Petrole Brut Baril	89,99	91,35
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,1631	3,1725
Gaz naturel	7,631	7,764
Or 1 Oc	1664,14	1672,66

## DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,9974	0,9971
EUR/JPY	143,069	143,063
EUR/GBP	0,87772	0,87767
EUR/CAD	1,32804	1,32787
EUR/CNY	7,0012	6,99411
EUR/BRL	5,24252	5,2361

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	21,61	21,85	12,26	13,05
3 mois	65,65	66,07	38,67	40,04
6 mois	133,28	134,88	77,53	82,62

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,49	0,79
Deposit EUR 1M	0,49	0,79
Deposit EUR 2M	0,7	1
Deposit EUR 3M	0,87	1,17
Deposit EUR 6M	1,51	1,81
Deposit EUR 12M	2,03	2,33

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,66	16/09/2022
EURIBOR 1W EUR	0,646	16/09/2022
EURIBOR 1M EUR	0,678	16/09/2022
EURIBOR 3M EUR	1,063	16/09/2022
EURIBOR 6M EUR	1,672	16/09/2022
EURIBOR 12M EUR	2,263	16/09/2022

	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		
I DEC22		
I MAR23		
I JUN23		
I DEC23		

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,631	0,672
OIS EUR 3M	1,014	1,055
OIS EUR 6M	1,605	1,646
OIS EUR 1Y	2,125	2,166
OIS EUR 2Y	2,312	2,353
OIS EUR 3Y	2,264	2,305

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,573	1,593
FRA EUR 2x5	1,946	1,966
FRA EUR 3x6	2,266	2,286
FRA EUR 6x9	2,76	2,78
FRA EUR 9x12	2,848	2,868
FRA EUR 3x9	2,553	2,573
FRA EUR 6x12	2,861	2,881
FRA EUR 9x15	2,891	2,911
FRA EUR 12x24	2,9	2,92

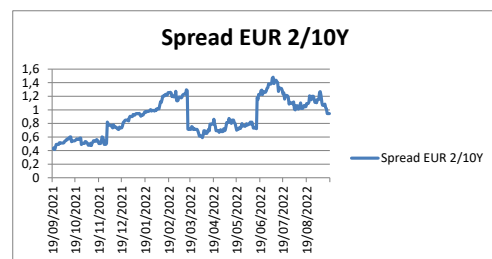
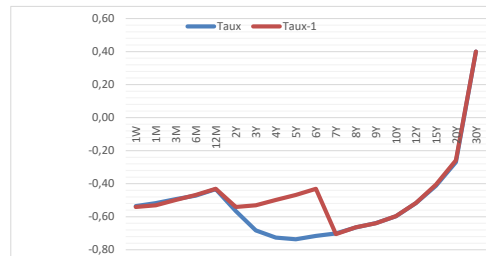
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

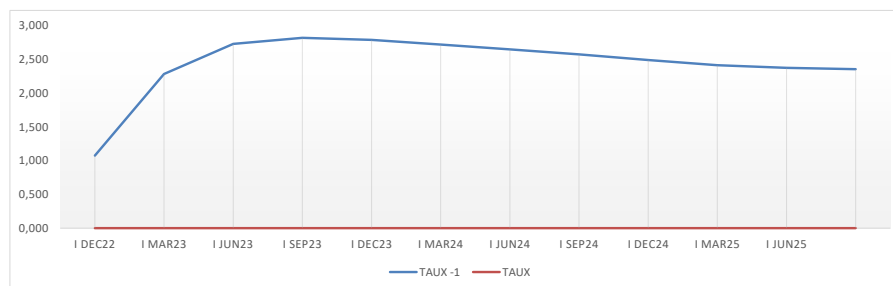
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,274	2,314
IRS EUR 2Y	2,504	2,544
IRS EUR 3Y	2,479	2,519
IRS EUR 4Y	2,465	2,505
IRS EUR 5Y	2,468	2,508
IRS EUR 6Y	2,471	2,511
IRS EUR 7Y	2,477	2,517
IRS EUR 10Y	2,55	2,59



TAUX EURIBOR	16/09/2022	15/09/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	0,65	0,65	-0,004
EURIBOR 1M EUR	0,68	0,68	-0,002
EURIBOR 3M EUR	1,06	1,03	0,033
EURIBOR 6M EUR	1,67	1,61	0,064
EURIBOR 12M EUR	2,26	2,22	0,040
	16/09/2022	15/09/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,33	1,29	0,043
XEU Benchmark 3Y	1,46	1,47	-0,011
XEU Benchmark 4Y	1,81	1,79	0,024
XEU Benchmark 5Y	1,89	1,88	0,007
XEU Benchmark 6Y	1,62	1,63	-0,016
XEU Benchmark 7Y	1,62	1,63	-0,015
XEU Benchmark 8Y	1,63	1,64	-0,013
XEU Benchmark 9Y	2,05	2,05	0,001
XEU Benchmark 10Y	2,22	2,23	-0,010
XEU Benchmark 12Y	2,44	2,44	-0,003
XEU Benchmark 15Y	1,87	1,87	-0,003
XEU Benchmark 20Y	1,76	1,77	-0,002
TEC 30	2,59	2,61	-0,020

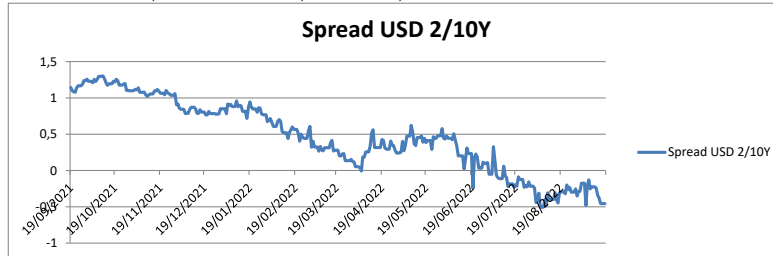
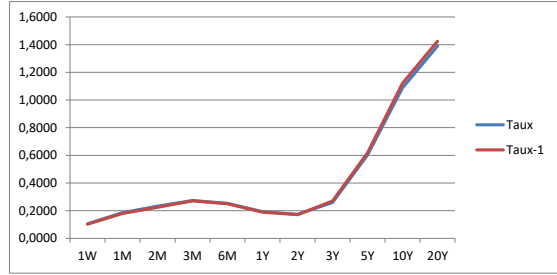


EURIBOR3M	1,063						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	16/09/2022	16/09/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I SEP22		98,925	#VALEUR!		1,075	#VALEUR!	
I DEC22		97,715	#VALEUR!		2,285	#VALEUR!	
I MAR23		97,27	#VALEUR!		2,730	#VALEUR!	
I JUN23		97,18	#VALEUR!		2,820	#VALEUR!	
I SEP23		97,21	#VALEUR!		2,790	#VALEUR!	
I DEC23		97,28	#VALEUR!		2,720	#VALEUR!	
I MAR24		97,35	#VALEUR!		2,650	#VALEUR!	
I JUN24		97,425	#VALEUR!		2,575	#VALEUR!	
I SEP24		97,51	#VALEUR!		2,490	#VALEUR!	
I DEC24		97,585	#VALEUR!		2,415	#VALEUR!	
I MAR25		97,625	#VALEUR!		2,375	#VALEUR!	
I JUN25		97,645	#VALEUR!		2,355	#VALEUR!	



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	16/09/2022	15/09/2022	Δ
SOFR	2,2800	2,2700	2,270
SOFR 30 Day	2,2840	2,2844	2,284
SOFR 90 Day	1,9438	1,9346	1,935
SOFR 180 Day	1,2434	1,2323	1,232
	<b>16/09/2022</b>	<b>15/09/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	4,1689	3,9725	3,973
US Benchmark 2Y	4,0400	3,9470	3,947
US Benchmark 3Y	3,9361	3,9482	3,948
US Benchmark 5Y	3,6564	3,7388	3,739
US Benchmark 10Y	3,4380	3,4898	3,490
US Benchmark 20Y	3,7775	3,7594	3,759
US Benchmark 30Y	3,4984	3,5035	3,504



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	15/09/2022	14/09/2022	Δ
SONIA	1,6910	1,6914	1,6914
LIBOR 1M GBP Synth	2,2447	2,2421	2,2421
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,7557	2,7428	2,7428
LIBOR 6M/ GBP Synt	3,5181	3,5052	3,5052
	<b>16/09/2022</b>	<b>15/09/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	2,9165	3,0092	3,009167
UK Benchmark 2Y	3,2396	3,1857	3,185658
UK Benchmark 3Y	3,3445	3,3031	3,303119
UK Benchmark 4Y	3,1937	3,1605	3,160525
UK Benchmark 5Y	3,1615	3,1294	3,129374
UK Benchmark 6Y	3,1131	3,0754	3,075431
UK Benchmark 7Y	3,1783	3,1480	3,147996
UK Benchmark 8Y	3,1162	3,1008	3,100766
UK Benchmark 9Y	3,1877	3,2111	3,211119
UK Benchmark 10Y	3,2341	3,2266	3,226553
UK Benchmark 12Y	3,3943	3,3955	3,395486
UK Benchmark 15Y	3,4984	3,5010	3,501047
UK Benchmark 20Y	3,5573	3,5506	3,550585

