

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,91%	3,91%	3,84	0,065
DE Benchmark 10Y	2,12%	2,11%	2,12	0,002
FR Benchmark 10Y	2,70%	2,70%	2,72	-0,0181
FR Benchmark 5Y	2,45%	2,43%	2,45	0,001
UK Benchmark 10Y	4,28%	4,27%	4,09	0,191
TEC 10	2,62			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	78,14	76,71
Petrole Brut Baril	85,57	84,06
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,1843	3,1291
Gaz naturel	7,054	6,903
Or 1 Oc	1637,45	1622,12

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,96476	0,96465
EUR/JPY	139,267	139,257
EUR/GBP	0,89357	0,89344
EUR/CAD	1,3179	1,31759
EUR/CNY	6,90452	6,89743
EUR/BRL	5,20344	5,19717

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	22,31	22,46	14,27	15,03
3 mois	63,25	63,51	50,64	51,97
6 mois	131,41	132,48	113,86	119,73

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,44	0,74
Deposit EUR 1M	0,46	0,76
Deposit EUR 2M	0,78	1,08
Deposit EUR 3M	0,98	1,28
Deposit EUR 6M	1,62	1,92
Deposit EUR 12M	2,3	2,6

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,663	26/09/2022
EURIBOR 1W EUR	0,654	23/09/2022
EURIBOR 1M EUR	0,698	23/09/2022
EURIBOR 3M EUR	1,153	23/09/2022
EURIBOR 6M EUR	1,803	23/09/2022
EURIBOR 12M EUR	2,5	23/09/2022

	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 DEC22	97,615	97,62
I MAR23	97,02	97,025
I JUN23	96,735	96,74
I DEC23	96,7	96,705
I MAR24	96,75	96,755

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,64	0,681
OIS EUR 3M	1,159	1,2
OIS EUR 6M	1,727	1,768
OIS EUR 1Y	2,352	2,393
OIS EUR 2Y	2,703	2,744
OIS EUR 3Y	2,731	2,772

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,702	1,722
FRA EUR 2x5	2,108	2,128
FRA EUR 3x6	2,481	2,501
FRA EUR 6x9	3,013	3,033
FRA EUR 9x12	3,265	3,285
FRA EUR 3x9	2,774	2,794
FRA EUR 6x12	3,221	3,241
FRA EUR 9x15	3,376	3,396
FRA EUR 12x24	3,581	3,601

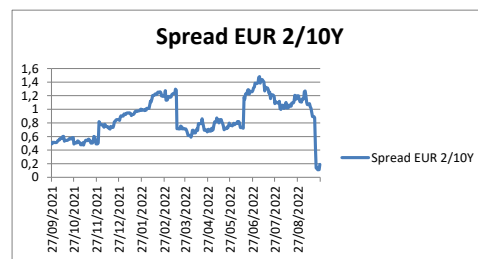
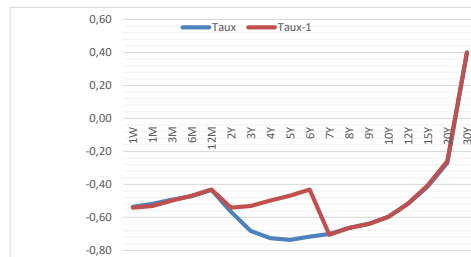
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

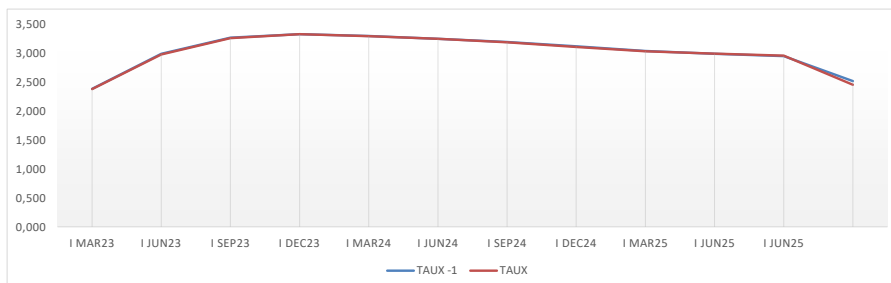
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,53	2,57
IRS EUR 2Y	2,934	2,974
IRS EUR 3Y	2,973	3,013
IRS EUR 4Y	2,97	3,01
IRS EUR 5Y	2,98	3,02
IRS EUR 6Y	2,968	3,008
IRS EUR 7Y	2,959	2,999
IRS EUR 10Y	2,976	3,016



	23/09/2022	22/09/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	0,65	0,65	0,005
EURIBOR 1M EUR	0,70	0,68	0,018
EURIBOR 3M EUR	1,15	1,12	0,033
EURIBOR 6M EUR	1,80	1,76	0,040
EURIBOR 12M EUR	2,50	2,44	0,058
	26/09/2022	23/09/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,96	1,89	0,071
XEU Benchmark 3Y	1,87	1,79	0,087
XEU Benchmark 4Y	2,32	2,22	0,101
XEU Benchmark 5Y	2,12	2,00	0,120
XEU Benchmark 6Y	2,09	1,96	0,132
XEU Benchmark 7Y	2,07	1,94	0,135
XEU Benchmark 8Y	2,07	1,92	0,144
XEU Benchmark 9Y	2,49	2,36	0,126
XEU Benchmark 10Y	2,15	2,00	0,149
XEU Benchmark 12Y	2,83	2,69	0,140
XEU Benchmark 15Y	2,21	2,07	0,141
XEU Benchmark 20Y	2,05	1,91	0,137
TEC 30	2,76	2,72	0,040

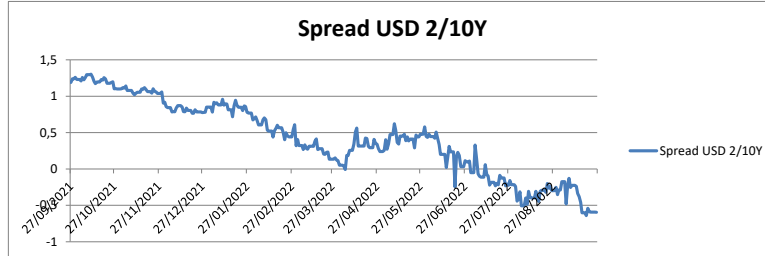
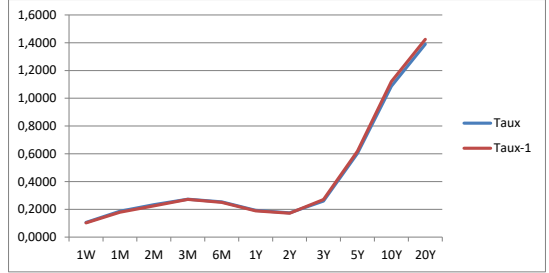


EURIBOR3M	1,153						
EURIBOR 3M EUR	27/09/2022	26/09/2022	TAUX	Δ	TAUX VILLE	Δ/FIX	
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC22	97,62	97,615	2,380		95,240	2,385	1,227
I MAR23	97,02	97,01	2,980		94,040	2,990	1,827
I JUN23	96,74	96,73	3,260		93,480	3,270	2,107
I SEP23	96,67	96,67	3,330		93,340	3,330	2,177
I DEC23	96,705	96,7	3,295		93,410	3,300	2,142
I MAR24	96,75	96,75	3,250		93,500	3,250	2,097
I JUN24	96,81	96,805	3,190		93,620	3,195	2,037
I SEP24	96,89	96,88	3,110		93,780	3,120	1,957
I DEC24	96,965	96,96	3,035		93,930	3,040	1,882
I MAR25	97,005	97,01	2,995		94,010	2,990	1,842
I JUN25	97,04	97,05	2,960		94,080	2,950	1,807
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	1,302



TAUX US EMPRUNTEUR 

	26/09/2022	22/09/2022	Δ
SOFR	2,9900	2,9900	2,990
SOFR 30 Day	2,3762	2,2807	2,281
SOFR 90 Day	2,0664	1,9985	1,999
SOFR 180 Day	1,3706	1,3099	1,310
	26/09/2022	23/09/2022	
USA Benchmark 1Y	4,3633	4,2502	4,250
US Benchmark 2Y	4,3715	4,3230	4,323
US Benchmark 3Y	4,3558	4,3061	4,306
US Benchmark 5Y	4,0518	3,9100	3,910
US Benchmark 10Y	3,7757	3,7302	3,730
US Benchmark 20Y	3,9375	3,9022	3,902
US Benchmark 30Y	3,6321	3,6422	3,642



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	22/09/2022	21/09/2022	Δ
SONIA	2,1876	1,6903	1,6903
LIBOR 1M GBP Synth	2,2226	2,3797	2,3797
LIBOR 3M/ GBP Synt	2,8031	2,9122	2,9122
LIBOR 6M/ GBP Synt	3,6420	3,6782	3,6782
	26/09/2022	23/09/2022	
UK Benchmark 1Y	4,5186	3,9748	3,974849
UK Benchmark 2Y	4,8272	4,3418	4,341819
UK Benchmark 3Y	4,5544	4,0631	4,063117
UK Benchmark 4Y	4,6893	4,2200	4,21995
UK Benchmark 5Y	4,5682	4,0982	4,098172
UK Benchmark 6Y	4,4586	4,0469	4,046874
UK Benchmark 7Y	4,4221	3,9700	3,969964
UK Benchmark 8Y	4,2767	3,8576	3,857564
UK Benchmark 9Y	4,2494	3,5439	3,543947
UK Benchmark 10Y	4,2543	3,8945	3,894499
UK Benchmark 12Y	4,3507	3,9990	3,998997
UK Benchmark 15Y	4,5089	4,0744	4,07435
UK Benchmark 20Y	4,4962	4,1064	4,106367

