

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,95%	3,94%	3,98	-0,033
DE Benchmark 10Y	2,23%	2,22%	2,26	-0,032
FR Benchmark 10Y	2,85%	2,84%	2,86	-0,0101
FR Benchmark 5Y	2,55%	2,54%	2,54	0,011
UK Benchmark 10Y	4,51%	4,50%	4,52	-0,001
TEC 10	2,65			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	76,84	78,5
Petrole Brut Baril	84,53	86,27
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,198	3,2599
Gaz naturel	6,68	6,651
Or 1 Oc	1616,9	1629,09

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,9557	0,9554
EUR/JPY	138,215	138,205
EUR/GBP	0,89531	0,89524
EUR/CAD	1,31837	1,31812
EUR/CNY	6,9147	6,9073
EUR/BRL	5,1433	5,13771

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	20,55	20,73	14,19	15,62
3 mois	61,54	61,85	53,49	55,98
6 mois	128,34	129,61	125,19	136,27

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,44	0,74
Deposit EUR 1M	0,47	0,77
Deposit EUR 2M	0,78	1,08
Deposit EUR 3M	0,98	1,28
Deposit EUR 6M	1,64	1,94
Deposit EUR 12M	2,29	2,59

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,662	27/09/2022
EURIBOR 1W EUR	0,666	26/09/2022
EURIBOR 1M EUR	0,7	26/09/2022
EURIBOR 3M EUR	1,168	26/09/2022
EURIBOR 6M EUR	1,803	26/09/2022
EURIBOR 12M EUR	2,563	26/09/2022

	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	97,65	97,655
I MAR23	97,035	97,04
I JUN23	96,735	96,74
I DEC23	96,655	96,66
I MAR24	96,675	96,68

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,64	0,681
OIS EUR 3M	1,157	1,198
OIS EUR 6M	1,719	1,76
OIS EUR 1Y	2,333	2,374
OIS EUR 2Y	2,708	2,749
OIS EUR 3Y	2,777	2,818

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,683	1,703
FRA EUR 2x5	2,1	2,12
FRA EUR 3x6	2,404	2,424
FRA EUR 6x9	3,027	3,047
FRA EUR 9x12	3,272	3,292
FRA EUR 3x9	2,774	2,794
FRA EUR 6x12	3,224	3,244
FRA EUR 9x15	3,373	3,393
FRA EUR 12x24	3,644	3,664

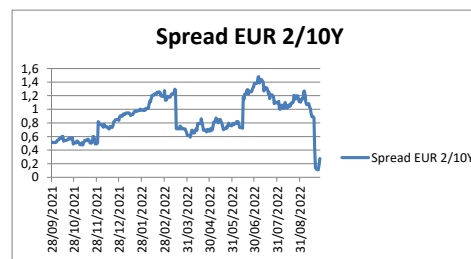
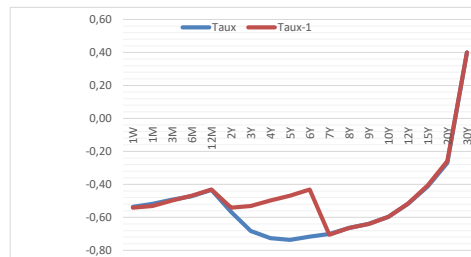
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

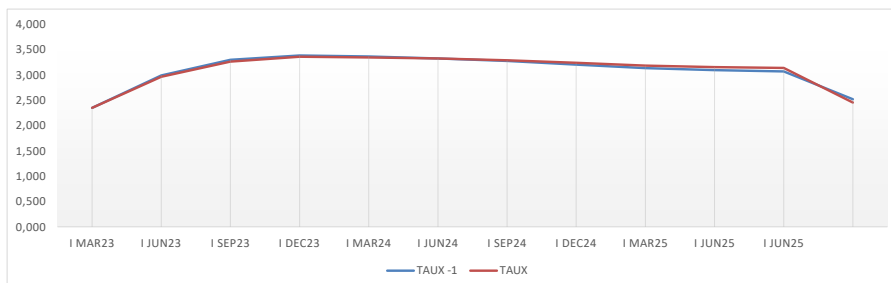
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,528	2,568
IRS EUR 2Y	2,946	2,986
IRS EUR 3Y	3,028	3,068
IRS EUR 4Y	3,041	3,081
IRS EUR 5Y	3,059	3,099
IRS EUR 6Y	3,072	3,112
IRS EUR 7Y	3,087	3,127
IRS EUR 10Y	3,158	3,198



	26/09/2022	23/09/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	0,67	0,65	0,012
EURIBOR 1M EUR	0,70	0,70	0,002
EURIBOR 3M EUR	1,17	1,15	0,015
EURIBOR 6M EUR	1,80	1,80	0,000
EURIBOR 12M EUR	2,56	2,50	0,063
	27/09/2022	26/09/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,96	1,96	0,002
XEU Benchmark 3Y	1,89	1,87	0,020
XEU Benchmark 4Y	2,38	2,32	0,055
XEU Benchmark 5Y	2,17	2,12	0,048
XEU Benchmark 6Y	2,15	2,09	0,057
XEU Benchmark 7Y	2,14	2,07	0,068
XEU Benchmark 8Y	2,14	2,07	0,077
XEU Benchmark 9Y	2,58	2,49	0,088
XEU Benchmark 10Y	2,23	2,15	0,089
XEU Benchmark 12Y	2,92	2,83	0,090
XEU Benchmark 15Y	2,31	2,21	0,100
XEU Benchmark 20Y	2,16	2,05	0,111
TEC 30	2,79	2,76	0,030

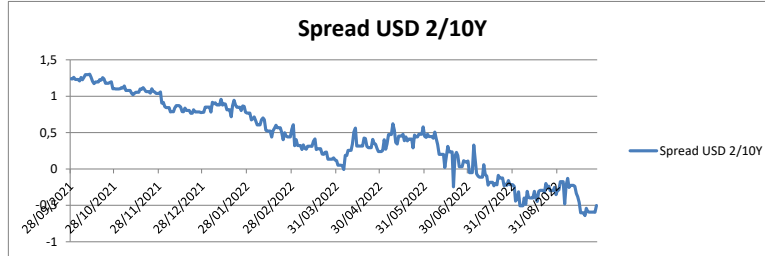
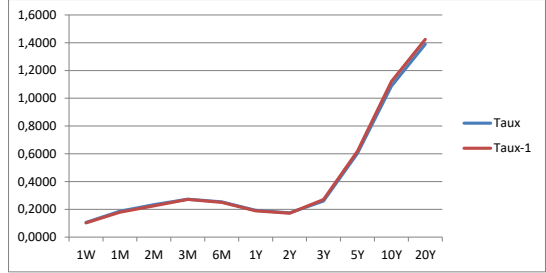


EURIBOR3M	1,168						
EURIBOR 3M EUR	1,168						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	28/09/2022	27/09/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I DEC22	97,65	97,65	2,350		95,300	2,350	1,182
I MAR23	97,035	97,01	2,965		94,070	2,990	1,797
I JUN23	96,735	96,7	3,265		93,470	3,300	2,097
I SEP23	96,64	96,615	3,360		93,280	3,385	2,192
I DEC23	96,655	96,635	3,345		93,310	3,365	2,177
I MAR24	96,675	96,675	3,325		93,350	3,325	2,157
I JUN24	96,71	96,725	3,290		93,420	3,275	2,122
I SEP24	96,76	96,795	3,240		93,520	3,205	2,072
I DEC24	96,815	96,865	3,185		93,630	3,135	2,017
I MAR25	96,845	96,905	3,155		93,690	3,095	1,987
I JUN25	96,86	96,93	3,140		93,720	3,070	1,972
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	1,287



TAUX US EMPRUNTEUR 

	27/09/2022	23/09/2022	Δ
SOFR	2,9900	2,9900	2,990
SOFR 30 Day	2,3999	2,3047	2,305
SOFR 90 Day	2,0828	2,0156	2,016
SOFR 180 Day	1,3858	1,3251	1,325
	27/09/2022	26/09/2022	
USA Benchmark 1Y	4,3523	4,3633	4,363
US Benchmark 2Y	4,4525	4,3715	4,372
US Benchmark 3Y	4,4773	4,3558	4,356
US Benchmark 5Y	4,0952	4,0518	4,052
US Benchmark 10Y	3,9522	3,7758	3,776
US Benchmark 20Y	4,0869	3,9375	3,938
US Benchmark 30Y	3,8013	3,6321	3,632



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	23/09/2022	22/09/2022	Δ
SONIA	2,1884	2,1876	2,1876
LIBOR 1M GBP Synth	2,8781	2,2226	2,2226
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,7532	2,8031	2,8031
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,6872	3,6420	3,642
	27/09/2022	26/09/2022	
UK Benchmark 1Y	4,5778	4,5186	4,518573
UK Benchmark 2Y	4,8927	4,8272	4,827151
UK Benchmark 3Y	4,6236	4,5544	4,554439
UK Benchmark 4Y	4,8235	4,6893	4,689348
UK Benchmark 5Y	4,6967	4,5682	4,568215
UK Benchmark 6Y	4,6602	4,4586	4,45855
UK Benchmark 7Y	4,6088	4,4221	4,422148
UK Benchmark 8Y	4,4847	4,2767	4,276703
UK Benchmark 9Y	4,2255	4,2494	4,24941
UK Benchmark 10Y	4,4910	4,2543	4,254266
UK Benchmark 12Y	4,5695	4,3507	4,350734
UK Benchmark 15Y	4,7939	4,5089	4,508872
UK Benchmark 20Y	4,8656	4,4962	4,496185

