

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,83%	3,82%	3,78	0,046
DE Benchmark 10Y	2,11%	2,10%	2,12	-0,012
FR Benchmark 10Y	2,72%	2,72%	2,75	-0,0204
FR Benchmark 5Y	2,36%	2,35%	2,37	-0,012
UK Benchmark 10Y	4,15%	4,14%	4,00	0,153
TEC 10	2,71			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	82,63	79,49
Petrole Brut Baril	88,45	85,14
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,3285	3,2216
Gaz naturel	6,63	6,766
Or 1 Oc	1663,64	1660,67

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,98156	0,98145
EUR/JPY	142,29	142,259
EUR/GBP	0,87575	0,87561
EUR/CAD	1,34987	1,34963
EUR/CNY	6,98874	6,97997
EUR/BRL	5,31906	5,31284

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	22,12	22,3	11,71	15,4
3 mois	75,15	75,61	46,22	55,14
6 mois	133,86	135,14	97,85	126,59

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,31	0,61
Deposit EUR 1M	0,49	0,79
Deposit EUR 2M	0,82	1,12
Deposit EUR 3M	0,88	1,18
Deposit EUR 6M	1,63	1,93
Deposit EUR 12M	2,2	2,5

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,642	30/09/2022
EURIBOR 1W EUR	0,648	30/09/2022
EURIBOR 1M EUR	0,679	30/09/2022
EURIBOR 3M EUR	1,173	30/09/2022
EURIBOR 6M EUR	1,809	30/09/2022
EURIBOR 12M EUR	2,556	30/09/2022

	30/09/2022	31/08/2022
TMO	2,6	1,83
TME	2,4	1,63
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	97,75	97,755
I MAR23	97,185	97,19
I JUN23	96,935	96,94
I DEC23	96,95	96,955
I MAR24	96,985	96,99

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	0,746	0,787
OIS EUR 3M	1,232	1,273
OIS EUR 6M	1,733	1,774
OIS EUR 1Y	2,26	2,301
OIS EUR 2Y	2,533	2,574
OIS EUR 3Y	2,578	2,619

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,662	1,682
FRA EUR 2x5	2,031	2,051
FRA EUR 3x6	2,479	2,499
FRA EUR 6x9	2,804	2,824
FRA EUR 9x12	3,005	3,025
FRA EUR 3x9	2,678	2,698
FRA EUR 6x12	3,022	3,042
FRA EUR 9x15	3,121	3,141
FRA EUR 12x24	3,258	3,278

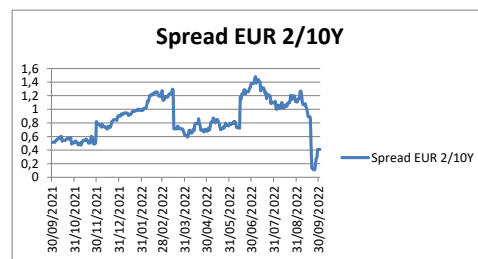
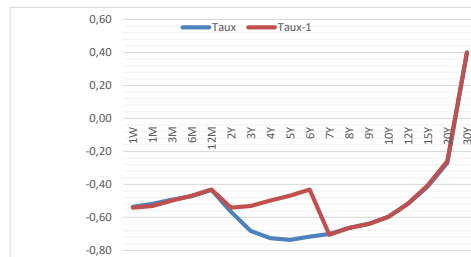
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

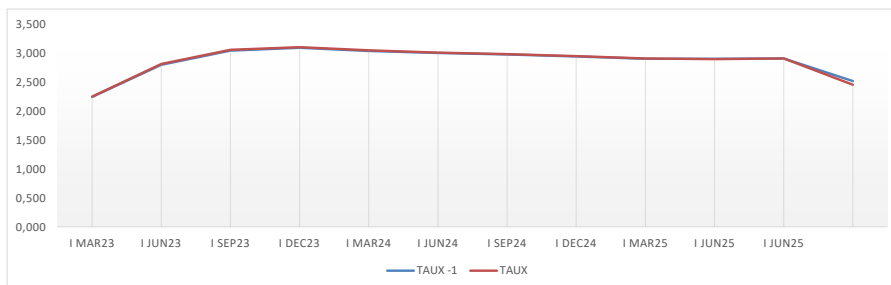
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,404	2,444
IRS EUR 2Y	2,745	2,785
IRS EUR 3Y	2,807	2,847
IRS EUR 4Y	2,86	2,9
IRS EUR 5Y	2,909	2,949
IRS EUR 6Y	2,946	2,986
IRS EUR 7Y	2,978	3,018
IRS EUR 10Y	3,079	3,119



TAUX EURIBOR	30/09/2022	29/09/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	0,65	0,65	-0,003
EURIBOR 1M EUR	0,68	0,67	0,013
EURIBOR 3M EUR	1,17	1,16	0,013
EURIBOR 6M EUR	1,81	1,80	0,009
EURIBOR 12M EUR	2,56	2,58	-0,022
XEU Benchmark 2Y	30/09/2022	29/09/2022	Δ
XEU Benchmark 2Y	1,74	1,81	-0,068
XEU Benchmark 3Y	1,68	1,76	-0,084
XEU Benchmark 4Y	2,16	2,25	-0,085
XEU Benchmark 5Y	1,95	2,06	-0,114
XEU Benchmark 6Y	1,95	2,06	-0,108
XEU Benchmark 7Y	1,96	2,07	-0,115
XEU Benchmark 8Y	1,98	2,10	-0,119
XEU Benchmark 9Y	2,45	2,54	-0,087
XEU Benchmark 10Y	2,10	2,22	-0,117
XEU Benchmark 12Y	2,85	2,93	-0,075
XEU Benchmark 15Y	2,25	2,34	-0,094
XEU Benchmark 20Y	2,17	2,24	-0,071
TEC 30	2,97	2,99	-0,020



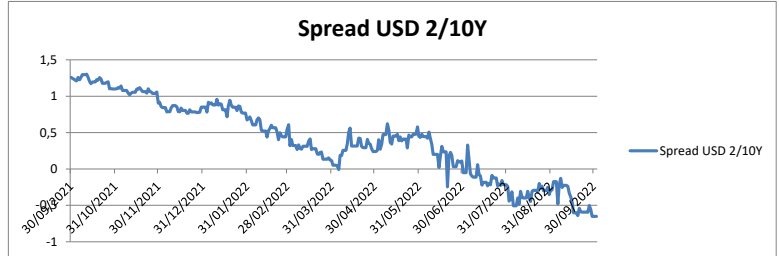
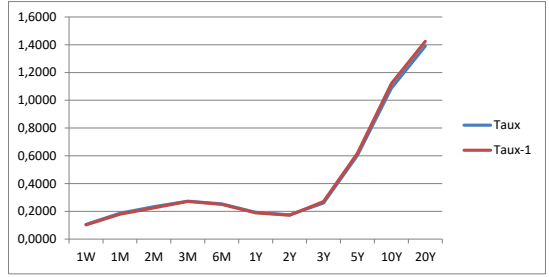
EURIBOR3M	1,173					
EURIBOR 3M EUR	1,173					
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	03/10/2022	30/09/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX
I DEC22	97,75	97,755	2,250	2,245	95,500	1,077
I MAR23	97,185	97,2	2,815	2,800	94,370	1,642
I JUN23	96,94	96,955	3,060	3,045	93,880	1,887
I SEP23	96,895	96,905	3,105	3,095	93,790	1,932
I DEC23	96,95	96,96	3,050	3,040	93,900	1,877
I MAR24	96,99	96,995	3,010	3,005	93,980	1,837
I JUN24	97,015	97,02	2,985	2,980	94,030	1,812
I SEP24	97,05	97,055	2,950	2,945	94,100	1,777
I DEC24	97,09	97,095	2,910	2,905	94,180	1,737
I MAR25	97,1	97,095	2,900	2,905	94,200	1,727
I JUN25	97,09	97,09	2,910	2,910	94,180	1,737
I JUN25	97,545	97,48	2,455	2,520	95,090	1,282



**TAUX US EMPRUNTEUR**



	30/09/2022	28/09/2022	Δ
SOFR	2,9600	2,9800	2,980
SOFR 30 Day	2,4690	2,4233	2,423
SOFR 90 Day	2,1319	2,0993	2,099
SOFR 180 Day	1,4307	1,4008	1,401
	<b>30/09/2022</b>	<b>29/09/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	4,3704	4,4078	4,408
US Benchmark 2Y	4,3641	4,4047	4,405
US Benchmark 3Y	4,3018	4,3592	4,359
US Benchmark 5Y	3,9485	4,0730	4,073
US Benchmark 10Y	3,7254	3,7534	3,753
US Benchmark 20Y	4,0267	4,0345	4,034
US Benchmark 30Y	3,7071	3,7003	3,700



**TAUX UK EMPRUNTEUR**



	29/09/2022	28/09/2022	Δ
SONIA	2,1890	2,1891	2,1891
LIBOR 1M GBP Synth	2,4905	2,4905	2,4905
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,6049	3,6049	3,6049
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,6769	4,6769	4,6769
	<b>30/09/2022</b>	<b>29/09/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	4,4077	4,6329	4,632861
UK Benchmark 2Y	4,8959	4,8952	4,895225
UK Benchmark 3Y	4,6027	4,5479	4,547869
UK Benchmark 4Y	4,5934	4,6120	4,611979
UK Benchmark 5Y	4,4626	4,4750	4,474999
UK Benchmark 6Y	4,6326	4,5058	4,505833
UK Benchmark 7Y	4,2934	4,3382	4,338217
UK Benchmark 8Y	4,3134	4,2639	4,263866
UK Benchmark 9Y	4,1949	4,3301	4,330149
UK Benchmark 10Y	4,3179	4,2662	4,266194
UK Benchmark 12Y	4,3844	4,3484	4,348359
UK Benchmark 15Y	4,2568	4,3426	4,34258
UK Benchmark 20Y	4,3020	4,2775	4,27745

