

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	4,01%	4,01%	4,06	-0,045
DE Benchmark 10Y	2,12%	2,11%	2,18	-0,060
FR Benchmark 10Y	2,65%	2,64%	2,71	-0,0544
FR Benchmark 5Y	2,34%	2,33%	2,40	-0,057
UK Benchmark 10Y	3,58%	3,57%	3,62	-0,041
TEC 10	2,68			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	87,5	87,91
Petrole Brut Brent	95,2	95,69
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,1293	4,1201
Gaz naturel	5,68	5,606
Or 1 Oc	1662,54	1664,77

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0067	1,0063
EUR/JPY	146,686	146,673
EUR/GBP	0,86829	0,8682
EUR/CAD	1,36726	1,36675
EUR/CNY	7,28224	7,2746
EUR/BRL	5,42324	5,41737

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	21,23	21,46	11,7	12,13
3 mois	75,93	76,55	40,11	41,18
6 mois	140,41	142,1	82,11	85,17

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,5	0,8
Deposit EUR 1M	1,07	1,37
Deposit EUR 2M	1,2	1,5
Deposit EUR 3M	1,34	1,64
Deposit EUR 6M	1,78	2,08
Deposit EUR 12M	2,21	2,51

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,656	26/10/2022
EURIBOR 1W EUR	0,664	25/10/2022
EURIBOR 1M EUR	1,038	25/10/2022
EURIBOR 3M EUR	1,577	25/10/2022
EURIBOR 6M EUR	2,106	25/10/2022
EURIBOR 12M EUR	2,725	25/10/2022

	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	0,566	0,019
EURIBOR 3M MOY MENS	1,002	0,395

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC22	97,775	97,78
I MAR23	97,26	97,265
I JUN23	97,025	97,03
I DEC23	97,015	97,02
I MAR24	97,05	97,055

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,31	1,351
OIS EUR 3M	1,614	1,655
OIS EUR 6M	1,982	2,023
OIS EUR 1Y	2,377	2,418
OIS EUR 2Y	2,56	2,601
OIS EUR 3Y	2,574	2,615

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,968	1,988
FRA EUR 2x5	2,289	2,309
FRA EUR 3x6	2,469	2,489
FRA EUR 6x9	2,861	2,881
FRA EUR 9x12	3,012	3,032
FRA EUR 3x9	2,755	2,775
FRA EUR 6x12	2,983	3,003
FRA EUR 9x15	3,062	3,082
FRA EUR 12x24	3,014	3,034

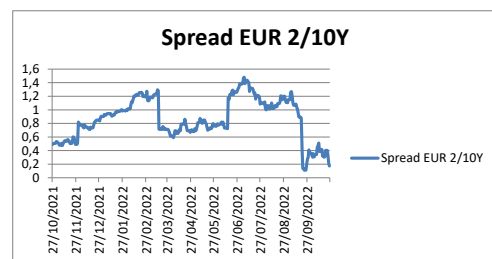
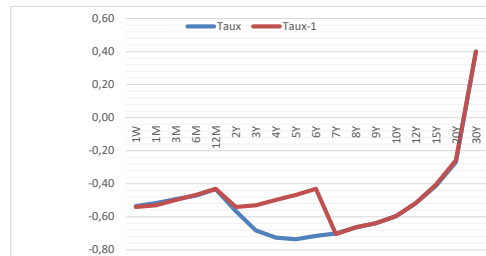
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

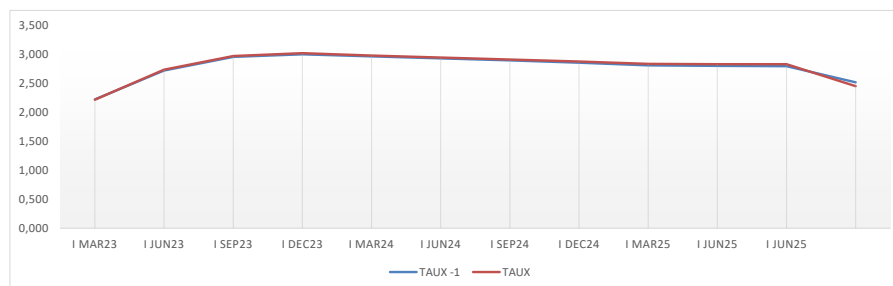
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,527	2,567
IRS EUR 2Y	2,763	2,803
IRS EUR 3Y	2,792	2,832
IRS EUR 4Y	2,811	2,851
IRS EUR 5Y	2,84	2,88
IRS EUR 6Y	2,865	2,905
IRS EUR 7Y	2,89	2,93
IRS EUR 10Y	2,993	3,033



TAUX EURIBOR	25/10/2022	24/10/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	0,66	0,67	-0,010
EURIBOR 1M EUR	1,04	0,98	0,059
EURIBOR 3M EUR	1,58	1,56	0,019
EURIBOR 6M EUR	2,11	2,13	-0,026
EURIBOR 12M EUR	2,73	2,74	-0,013
	26/10/2022	25/10/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,96	1,97	-0,014
XEU Benchmark 3Y	1,83	1,86	-0,022
XEU Benchmark 4Y	2,25	2,26	-0,017
XEU Benchmark 5Y	2,01	2,05	-0,039
XEU Benchmark 6Y	1,99	2,03	-0,041
XEU Benchmark 7Y	2,01	2,06	-0,045
XEU Benchmark 8Y	2,01	2,06	-0,049
XEU Benchmark 9Y	2,41	2,45	-0,033
XEU Benchmark 10Y	2,13	2,19	-0,056
XEU Benchmark 12Y	2,82	2,85	-0,034
XEU Benchmark 15Y	2,32	2,36	-0,045
XEU Benchmark 20Y	2,32	2,36	-0,040
TEC 30	2,94	3,06	-0,120

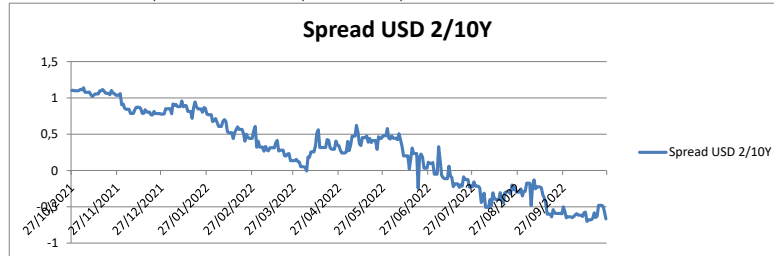
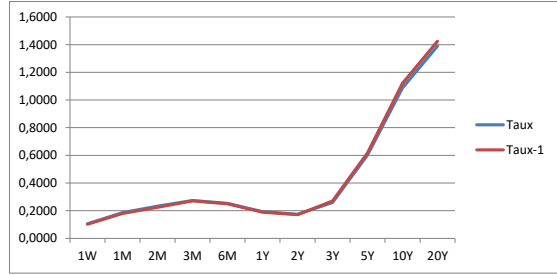


EURIBOR3M	1,577						
EURIBOR 3M EUR	1,577						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	27/10/2022	26/10/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I DEC22	97,78	97,775	2,220	2,225	95,560	0,643	
I MAR23	97,26	97,275	2,740	2,725	94,520	1,163	
I JUN23	97,025	97,04	2,975	2,960	94,050	1,398	
I SEP23	96,975	96,995	3,025	3,005	93,950	1,448	
I DEC23	97,015	97,03	2,985	2,970	94,030	1,408	
I MAR24	97,05	97,065	2,950	2,935	94,100	1,373	
I JUN24	97,085	97,1	2,915	2,900	94,170	1,338	
I SEP24	97,12	97,14	2,880	2,860	94,240	1,303	
I DEC24	97,16	97,185	2,840	2,815	94,320	1,263	
I MAR25	97,165	97,195	2,835	2,805	94,330	1,258	
I JUN25	97,165	97,2	2,835	2,800	94,330	1,258	
I JUN25	97,545	97,48	2,455	2,520	95,090	0,878	



TAUX US EMPRUNTEUR 

	26/10/2022	24/10/2022	Δ
SOFR	3,0200	3,0100	3,010
SOFR 30 Day	3,0262	3,0245	3,025
SOFR 90 Day	2,5672	2,5340	2,534
SOFR 180 Day	1,8301	1,7994	1,799
	26/10/2022	25/10/2022	
USA Benchmark 1Y	4,6932	4,6979	4,698
US Benchmark 2Y	4,6754	4,6483	4,648
US Benchmark 3Y	4,5118	4,5213	4,521
US Benchmark 5Y	4,2896	4,3747	4,375
US Benchmark 10Y	4,0080	4,0820	4,082
US Benchmark 20Y	4,3974	4,4915	4,492
US Benchmark 30Y	4,1536	4,2550	4,255



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	24/10/2022	21/10/2022	Δ
SONIA	2,1862	2,1850	2,185
LIBOR 1M GBP Synth	2,8021	2,7697	2,7697
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,3817	3,3727	3,3727
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,1445	4,1650	4,165
	26/10/2022	25/10/2022	
UK Benchmark 1Y	3,2558	3,3275	3,327543
UK Benchmark 2Y	3,6387	3,7250	3,725
UK Benchmark 3Y	3,5181	3,6254	3,625396
UK Benchmark 4Y	3,6828	3,7635	3,763543
UK Benchmark 5Y	3,7295	3,7981	3,798102
UK Benchmark 6Y	3,7668	3,8610	3,860965
UK Benchmark 7Y	3,6896	3,7628	3,76282
UK Benchmark 8Y	3,6524	3,7321	3,732086
UK Benchmark 9Y	3,7167	3,7840	3,784046
UK Benchmark 10Y	3,6803	3,7499	3,749949
UK Benchmark 12Y	3,7863	3,8373	3,837343
UK Benchmark 15Y	3,9482	3,9711	3,971103
UK Benchmark 20Y	3,9191	3,9522	3,95224

