

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,93%	3,93%	3,98	-0,046
DE Benchmark 10Y	1,96%	1,95%	2,04	-0,076
FR Benchmark 10Y	2,50%	2,49%	2,55	-0,0505
FR Benchmark 5Y	2,17%	2,15%	2,21	-0,041
UK Benchmark 10Y	3,41%	3,40%	3,45	-0,041
TEC 10	2,72			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	87,95	89,08
Petrole Brut Brent	96,04	96,96
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	4,3339	4,3339
Gaz naturel	5,79	5,186
Or 1 Oc	1650,7	1663,32

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,9934	0,99324
EUR/JPY	146,386	146,345
EUR/GBP	0,86279	0,86271
EUR/CAD	1,3524	1,35184
EUR/CNY	7,20616	7,19887
EUR/BRL	5,30946	5,30218

	EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
Pt de terme	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	20,71	21,07	11,26	11,86
3 mois	73,79	74,72	38,49	39,97
6 mois	140,06	142,6	81,34	85,55

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,5	0,8
Deposit EUR 1M	1,13	1,43
Deposit EUR 2M	1,25	1,55
Deposit EUR 3M	1,37	1,67
Deposit EUR 6M	1,79	2,09
Deposit EUR 12M	2,19	2,49

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,657	27/10/2022
EURIBOR 1W EUR	0,713	26/10/2022
EURIBOR 1M EUR	1,109	26/10/2022
EURIBOR 3M EUR	1,578	26/10/2022
EURIBOR 6M EUR	2,103	26/10/2022
EURIBOR 12M EUR	2,69	26/10/2022

	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	97,805	97,81
I MAR23	97,38	97,39
I JUN23	97,2	97,205
I DEC23	97,17	97,175
I MAR24	97,205	97,21

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,348	1,389
OIS EUR 3M	1,628	1,669
OIS EUR 6M	1,957	1,998
OIS EUR 1Y	2,274	2,315
OIS EUR 2Y	2,429	2,47
OIS EUR 3Y	2,44	2,481

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	1,957	1,977
FRA EUR 2x5	2,255	2,275
FRA EUR 3x6	2,385	2,405
FRA EUR 6x9	2,738	2,758
FRA EUR 9x12	2,856	2,876
FRA EUR 3x9	2,643	2,663
FRA EUR 6x12	2,844	2,864
FRA EUR 9x15	2,9	2,92
FRA EUR 12x24	2,808	2,828

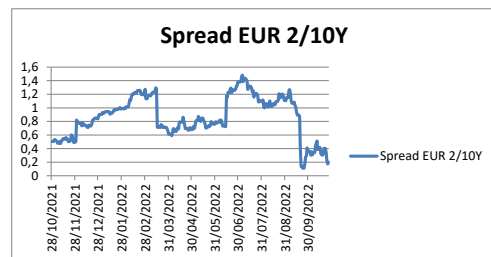
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

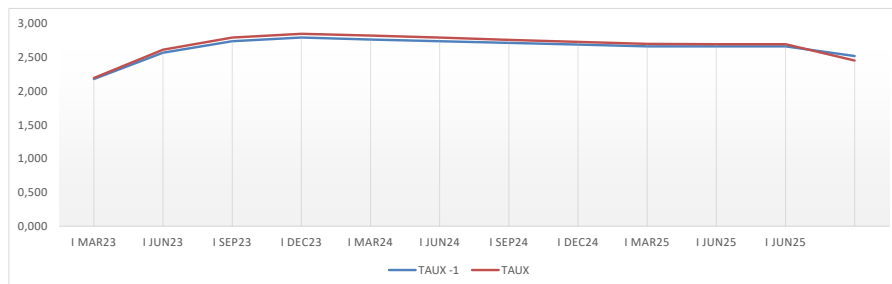
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,437	2,477
IRS EUR 2Y	2,641	2,681
IRS EUR 3Y	2,665	2,705
IRS EUR 4Y	2,683	2,723
IRS EUR 5Y	2,712	2,752
IRS EUR 6Y	2,742	2,782
IRS EUR 7Y	2,772	2,812
IRS EUR 10Y	2,883	2,923



TAUX EURIBOR	26/10/2022	25/10/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	0,71	0,66	0,049
EURIBOR 1M EUR	1,11	1,04	0,071
EURIBOR 3M EUR	1,58	1,58	0,001
EURIBOR 6M EUR	2,10	2,11	-0,003
EURIBOR 12M EUR	2,69	2,73	-0,035
	27/10/2022	26/10/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,78	1,96	-0,182
XEU Benchmark 3Y	1,65	1,83	-0,184
XEU Benchmark 4Y	2,05	2,25	-0,195
XEU Benchmark 5Y	1,82	2,01	-0,186
XEU Benchmark 6Y	1,82	1,99	-0,178
XEU Benchmark 7Y	1,84	2,01	-0,167
XEU Benchmark 8Y	1,86	2,01	-0,154
XEU Benchmark 9Y	2,21	2,41	-0,199
XEU Benchmark 10Y	1,98	2,13	-0,154
XEU Benchmark 12Y	2,63	2,82	-0,189
XEU Benchmark 15Y	2,19	2,32	-0,131
XEU Benchmark 20Y	2,20	2,32	-0,123
TEC 30	2,99	2,94	0,050

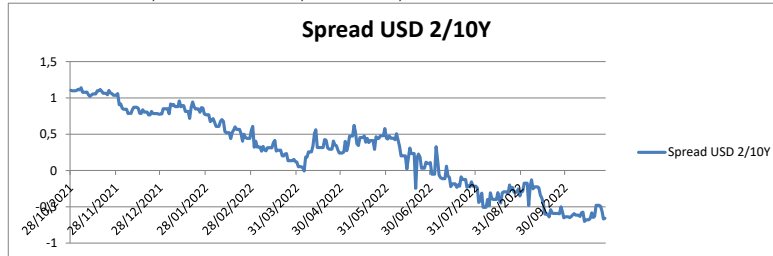
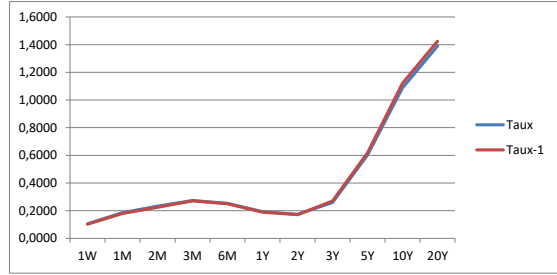


EURIBOR3M	1,578						
EURIBOR 3M EUR	1,578						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	28/10/2022	27/10/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I DEC22	97,805	97,82	2,195		95,610	2,180	0,617
I MAR23	97,385	97,43	2,615		94,770	2,570	1,037
I JUN23	97,205	97,26	2,795		94,410	2,740	1,217
I SEP23	97,15	97,205	2,850		94,300	2,795	1,272
I DEC23	97,175	97,235	2,825		94,350	2,765	1,247
I MAR24	97,205	97,26	2,795		94,410	2,740	1,217
I JUN24	97,24	97,285	2,760		94,480	2,715	1,182
I SEP24	97,27	97,31	2,730		94,540	2,690	1,152
I DEC24	97,3	97,335	2,700		94,600	2,665	1,122
I MAR25	97,305	97,335	2,695		94,610	2,665	1,117
I JUN25	97,305	97,335	2,695		94,610	2,665	1,117
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	0,877



TAUX US EMPRUNTEUR 

	27/10/2022	25/10/2022	Δ
SOFR	3,0300	3,0200	3,020
SOFR 30 Day	3,0276	3,0252	3,025
SOFR 90 Day	2,5756	2,5506	2,551
SOFR 180 Day	1,8455	1,8147	1,815
	27/10/2022	26/10/2022	
USA Benchmark 1Y	4,6643	4,6932	4,693
US Benchmark 2Y	4,5896	4,6754	4,675
US Benchmark 3Y	4,4243	4,5118	4,512
US Benchmark 5Y	4,2997	4,2896	4,290
US Benchmark 10Y	3,9306	4,0080	4,008
US Benchmark 20Y	4,3245	4,3974	4,397
US Benchmark 30Y	4,0820	4,1536	4,154



TAUX UK EMPRUNTEUR 

	25/10/2022	24/10/2022	Δ
SONIA	2,1862	2,1862	2,1862
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
	27/10/2022	26/10/2022	
UK Benchmark 1Y	3,2801	3,2558	3,255779
UK Benchmark 2Y	3,5485	3,6387	3,638701
UK Benchmark 3Y	3,4281	3,5181	3,518127
UK Benchmark 4Y	3,5423	3,6828	3,6828
UK Benchmark 5Y	3,5902	3,7295	3,729473
UK Benchmark 6Y	3,6965	3,7668	3,766792
UK Benchmark 7Y	3,5738	3,6896	3,689576
UK Benchmark 8Y	3,5671	3,6524	3,652354
UK Benchmark 9Y	3,7049	3,7167	3,716716
UK Benchmark 10Y	3,6024	3,6803	3,680336
UK Benchmark 12Y	3,6960	3,7863	3,786272
UK Benchmark 15Y	3,8534	3,9482	3,948247
UK Benchmark 20Y	3,8677	3,9191	3,919139

