

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	4,02%	4,01%	4,06	-0,048
DE Benchmark 10Y	2,10%	2,09%	2,15	-0,050
FR Benchmark 10Y	2,60%	2,59%	2,67	-0,0674
FR Benchmark 5Y	2,31%	2,30%	2,36	-0,055
UK Benchmark 10Y	3,47%	3,46%	3,52	-0,045
TEC 10	2,72			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	86,83	87,9
Petrole Brut Brent	94,52	95,77
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,6942	3,7455
Gaz naturel	6,157	5,684
Or 1 Oc	1636,1	1644,38

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	0,9921	0,99194
EUR/JPY	147,081	147,075
EUR/GBP	0,85805	0,85795
EUR/CAD	1,35471	1,3545
EUR/CNY	7,24878	7,24122
EUR/BRL	5,25746	5,25095

P't de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	20,8	20,98	11,2	11,61
3 mois	74,21	74,67	38,11	39,18
6 mois	138,28	139,56	77,9	80,97

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	0,5	0,8
Deposit EUR 1M	1,16	1,46
Deposit EUR 2M	1,16	1,46
Deposit EUR 3M	1,4	1,7
Deposit EUR 6M	1,77	2,07
Deposit EUR 12M	2,11	2,41

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	0,656	28/10/2022
EURIBOR 1W EUR	0,951	28/10/2022
EURIBOR 1M EUR	1,208	28/10/2022
EURIBOR 3M EUR	1,641	28/10/2022
EURIBOR 6M EUR	2,034	28/10/2022
EURIBOR 12M EUR	2,567	28/10/2022

	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	97,73	97,735
I MAR23	97,225	97,23
I JUN23	97,005	97,01
I DEC23	96,965	96,975
I MAR24	97	97,005

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,372	1,413
OIS EUR 3M	1,672	1,713
OIS EUR 6M	2,051	2,092
OIS EUR 1Y	2,436	2,477
OIS EUR 2Y	2,621	2,662
OIS EUR 3Y	2,634	2,675

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	2,038	2,058
FRA EUR 2x5	2,346	2,366
FRA EUR 3x6	2,562	2,582
FRA EUR 6x9	2,911	2,931
FRA EUR 9x12	3,053	3,073
FRA EUR 3x9	2,805	2,825
FRA EUR 6x12	3,121	3,141
FRA EUR 9x15	3,118	3,138
FRA EUR 12x24	3,235	3,255

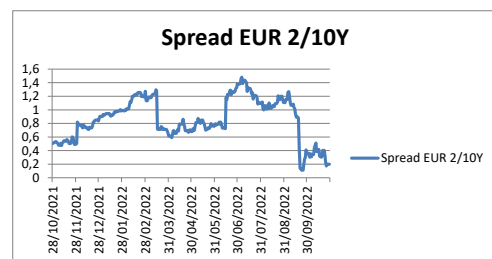
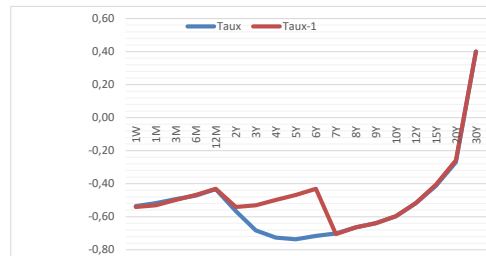
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

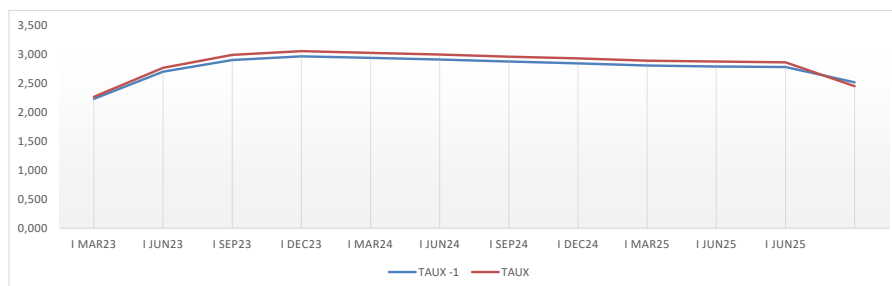
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,589	2,629
IRS EUR 2Y	2,826	2,866
IRS EUR 3Y	2,856	2,896
IRS EUR 4Y	2,863	2,903
IRS EUR 5Y	2,883	2,923
IRS EUR 6Y	2,901	2,941
IRS EUR 7Y	2,916	2,956
IRS EUR 10Y	3,005	3,045



	28/10/2022	27/10/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	0,95	0,81	0,141
EURIBOR 1M EUR	1,21	1,13	0,075
EURIBOR 3M EUR	1,64	1,61	0,036
EURIBOR 6M EUR	2,03	2,12	-0,084
EURIBOR 12M EUR	2,57	2,67	-0,104
	28/10/2022	27/10/2022	
XEU Benchmark 2Y	1,93	1,78	0,153
XEU Benchmark 3Y	1,81	1,65	0,162
XEU Benchmark 4Y	2,20	2,05	0,148
XEU Benchmark 5Y	1,99	1,82	0,172
XEU Benchmark 6Y	1,98	1,82	0,162
XEU Benchmark 7Y	1,99	1,84	0,149
XEU Benchmark 8Y	1,99	1,86	0,139
XEU Benchmark 9Y	2,36	2,21	0,150
XEU Benchmark 10Y	2,10	1,98	0,121
XEU Benchmark 12Y	2,76	2,63	0,135
XEU Benchmark 15Y	2,28	2,19	0,097
XEU Benchmark 20Y	2,27	2,20	0,075
TEC 30	2,99	2,99	0,000

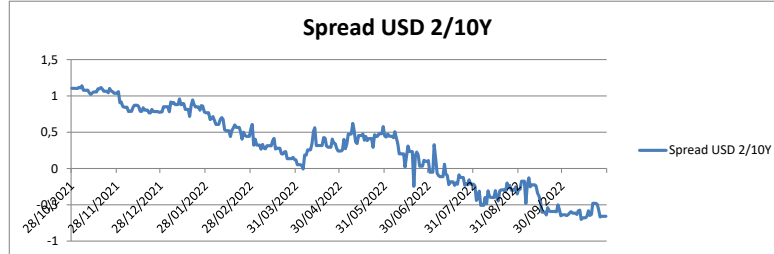
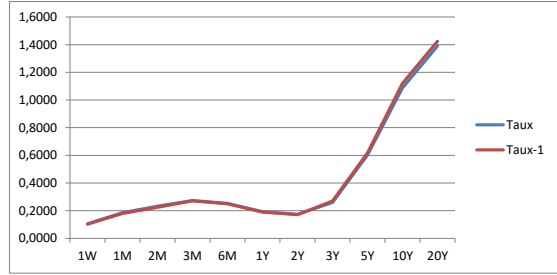


EURIBOR3M	1,641						
EURIBOR 3M EUR	31/10/2022	28/10/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS							
I DEC22	97,73	97,765	2,270		95,460	2,235	
I MAR23	97,23	97,295	2,770		94,460	2,705	
I JUN23	97,005	97,095	2,995		94,010	2,905	
I SEP23	96,94	97,03	3,060		93,880	2,970	
I DEC23	96,97	97,055	3,030		93,940	2,945	
I MAR24	97	97,085	3,000		94,000	2,915	
I JUN24	97,035	97,12	2,965		94,070	2,880	
I SEP24	97,065	97,15	2,935		94,130	2,850	
I DEC24	97,105	97,19	2,895		94,210	2,810	
I MAR25	97,12	97,205	2,880		94,240	2,795	
I JUN25	97,135	97,215	2,865		94,270	2,785	
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	28/10/2022	26/10/2022	Δ
SOFR	3,0400	3,0300	3,030
SOFR 30 Day	3,0296	3,0262	3,026
SOFR 90 Day	2,5842	2,5672	2,567
SOFR 180 Day	1,8610	1,8301	1,830
	<b>28/10/2022</b>	<b>27/10/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	4,6628	4,6643	4,664
US Benchmark 2Y	4,6245	4,5896	4,590
US Benchmark 3Y	4,4676	4,4243	4,424
US Benchmark 5Y	4,2053	4,2997	4,300
US Benchmark 10Y	3,9809	3,9306	3,931
US Benchmark 20Y	4,3593	4,3245	4,325
US Benchmark 30Y	4,1008	4,0820	4,082



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	27/10/2022	26/10/2022	Δ
SONIA	2,1852	2,1852	2,1852
LIBOR 1M GBP Synth	2,8146	2,8146	2,8146
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,3194	3,3194	3,3194
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,0407	4,0407	4,0407
	<b>28/10/2022</b>	<b>27/10/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	3,2873	3,2801	3,280092
UK Benchmark 2Y	3,5377	3,5485	3,548464
UK Benchmark 3Y	3,4026	3,4281	3,428073
UK Benchmark 4Y	3,5490	3,5423	3,542314
UK Benchmark 5Y	3,5966	3,5902	3,590202
UK Benchmark 6Y	3,6570	3,6965	3,696486
UK Benchmark 7Y	3,5501	3,5738	3,573809
UK Benchmark 8Y	3,5261	3,5671	3,567081
UK Benchmark 9Y	3,5956	3,7049	3,704944
UK Benchmark 10Y	3,5453	3,6024	3,602438
UK Benchmark 12Y	3,6491	3,6960	3,696033
UK Benchmark 15Y	3,8102	3,8534	3,853393
UK Benchmark 20Y	3,7947	3,8677	3,867735

