

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,83%	3,82%	3,81	0,017
DE Benchmark 10Y	2,02%	2,01%	2,02	-0,005
FR Benchmark 10Y	2,49%	2,48%	2,48	0,0107
FR Benchmark 5Y	2,26%	2,25%	2,27	-0,009
UK Benchmark 10Y	3,24%	3,23%	3,22	0,019
TEC 10	2,54			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	79,47	80,11
Petrole Brut Brent	86,79	87,62
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,4779	3,5181
Gaz naturel	6,277	6,303
Or 1 Oc	1740,99	1750,55

DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,0259	1,02579
EUR/JPY	144,758	144,749
EUR/GBP	0,86768	0,86757
EUR/CAD	1,37691	1,37669
EUR/CNY	7,35264	7,34524
EUR/BRL	5,52582	5,51953

EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
VENTE			
1 mois	22,13	12,21	12,41
3 mois	77,37	39,95	40,51
6 mois	141,5	77,02	78,44

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	1,16	1,46
Deposit EUR 1M	1,24	1,54
Deposit EUR 2M	1,46	1,76
Deposit EUR 3M	1,73	2,03
Deposit EUR 6M	2,02	2,32
Deposit EUR 12M	2,42	2,72

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	1,403	18/11/2022
EURIBOR 1W EUR	1,392	18/11/2022
EURIBOR 1M EUR	1,413	18/11/2022
EURIBOR 3M EUR	1,821	18/11/2022
EURIBOR 6M EUR	2,342	18/11/2022
EURIBOR 12M EUR	2,837	18/11/2022

	31/10/2022	30/09/2022
TMO	3,03	2,6
TME	2,83	2,4
TMM	0,7402	0,4225
EURIBOR 1M MOY MENS	0,913	0,566
EURIBOR 3M MOY MENS	1,422	1,002

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC22	97,81	97,815
I MAR23	97,16	97,165
I JUN23	96,95	96,955
I DEC23	97,02	97,03
I MAR24	97,125	97,13

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,422	1,463
OIS EUR 3M	1,857	1,898
OIS EUR 6M	2,226	2,267
OIS EUR 1Y	2,573	2,614
OIS EUR 2Y	2,619	2,66
OIS EUR 3Y	2,535	2,576

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	2,213	2,233
FRA EUR 2x5	2,502	2,522
FRA EUR 3x6	2,719	2,739
FRA EUR 6x9	2,992	3,012
FRA EUR 9x12	3,057	3,077
FRA EUR 3x9	2,931	2,951
FRA EUR 6x12	3,093	3,113
FRA EUR 9x15	3,09	3,11
FRA EUR 12x24	2,993	3,013

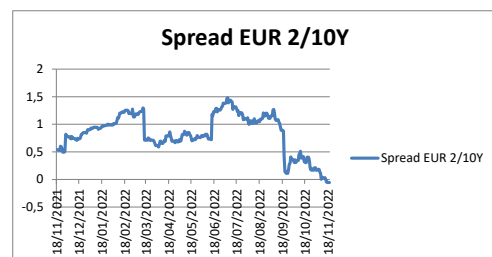
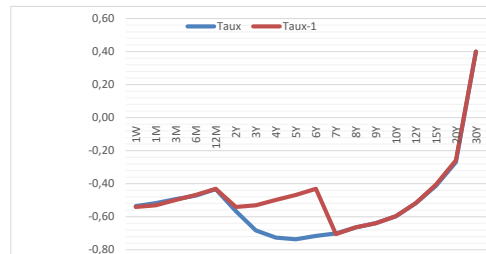
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

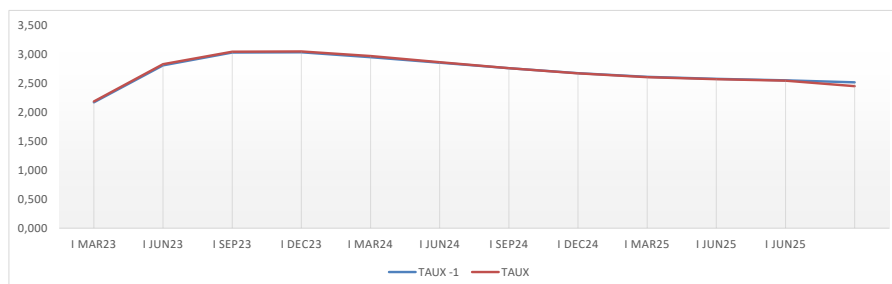
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	2,697	2,737
IRS EUR 2Y	2,792	2,832
IRS EUR 3Y	2,724	2,764
IRS EUR 4Y	2,683	2,723
IRS EUR 5Y	2,667	2,707
IRS EUR 6Y	2,66	2,7
IRS EUR 7Y	2,661	2,701
IRS EUR 10Y	2,728	2,768




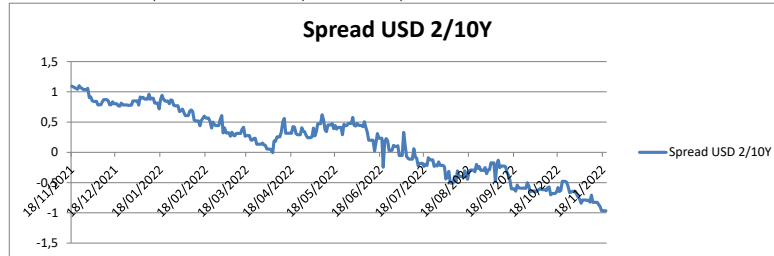
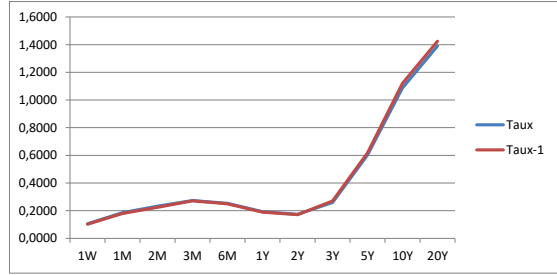
TAUX EURIBOR	18/11/2022	17/11/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	1,39	1,39	0,006
EURIBOR 1M EUR	1,41	1,43	-0,012
EURIBOR 3M EUR	1,82	1,80	0,019
EURIBOR 6M EUR	2,34	2,29	0,048
EURIBOR 12M EUR	2,84	2,83	0,003
	18/11/2022	17/11/2022	
XEU Benchmark 2Y	2,06	2,08	-0,021
XEU Benchmark 3Y	1,93	1,94	-0,017
XEU Benchmark 4Y	2,20	2,22	-0,026
XEU Benchmark 5Y	2,00	2,01	-0,008
XEU Benchmark 6Y	1,98	1,99	-0,009
XEU Benchmark 7Y	1,97	1,97	-0,008
XEU Benchmark 8Y	1,95	1,96	-0,005
XEU Benchmark 9Y	2,29	2,30	-0,016
XEU Benchmark 10Y	2,02	2,02	-0,001
XEU Benchmark 12Y	2,66	2,68	-0,019
XEU Benchmark 15Y	2,16	2,17	-0,009
XEU Benchmark 20Y	2,12	2,12	-0,004
TEC 30	2,78	2,73	0,050




EURIBOR3M	1,821						
EURIBOR 3M EUR	1,821						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	21/11/2022	18/11/2022	TAUX	Δ	TAUX VIEILLE	Δ/FIX	
I DEC22	97,81	97,825	2,190		95,620	2,175	0,369
I MAR23	97,165	97,185	2,835		94,330	2,815	1,014
I JUN23	96,95	96,965	3,050		93,900	3,035	1,229
I SEP23	96,945	96,96	3,055		93,890	3,040	1,234
I DEC23	97,025	97,045	2,975		94,050	2,955	1,154
I MAR24	97,13	97,14	2,870		94,260	2,860	1,049
I JUN24	97,235	97,235	2,765		94,470	2,765	0,944
I SEP24	97,325	97,32	2,675		94,650	2,680	0,854
I DEC24	97,39	97,385	2,610		94,780	2,615	0,789
I MAR25	97,425	97,42	2,575		94,850	2,580	0,754
I JUN25	97,45	97,445	2,550		94,900	2,555	0,729
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	0,634



TAUX US EMPRUNTEUR 				
	18/11/2022	16/11/2022	Δ	
SOFR	3,8000	3,8100	3,810	
SOFR 30 Day	3,4175	3,3667	3,367	
SOFR 90 Day	2,8887	2,8546	2,855	
SOFR 180 Day	2,2011	2,1671	2,167	
	18/11/2022	17/11/2022		
USA Benchmark 1Y	4,8637	4,8720	4,872	
US Benchmark 2Y	4,7484	4,7547	4,755	
US Benchmark 3Y	4,3702	4,3885	4,389	
US Benchmark 5Y	4,0313	3,9149	3,915	
US Benchmark 10Y	3,8083	3,7886	3,789	
US Benchmark 20Y	4,1477	4,1484	4,148	
US Benchmark 30Y	3,9332	3,9209	3,921	



TAUX UK EMPRUNTEUR 				
	17/11/2022	16/11/2022	Δ	
SONIA	2,9266	2,9265	2,9265	
LIBOR 1M GBP Synth	3,0376	3,0374	3,0374	
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,5706	3,5504	3,5504	
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,1418	4,1197	4,1197	
	18/11/2022	17/11/2022		
UK Benchmark 1Y	3,2646	3,2030	3,203049	
UK Benchmark 2Y	3,4534	3,3935	3,393511	
UK Benchmark 3Y	3,1552	3,0992	3,09916	
UK Benchmark 4Y	3,2974	3,2687	3,268658	
UK Benchmark 5Y	3,3325	3,3013	3,301344	
UK Benchmark 6Y	3,3630	3,3376	3,33761	
UK Benchmark 7Y	3,2741	3,2434	3,243412	
UK Benchmark 8Y	3,2497	3,2273	3,227268	
UK Benchmark 9Y	3,3005	3,1773	3,177261	
UK Benchmark 10Y	3,3149	3,2859	3,285909	
UK Benchmark 12Y	3,4338	3,4013	3,401261	
UK Benchmark 15Y	3,5918	3,5625	3,562483	
UK Benchmark 20Y	3,5756	3,6030	3,603022	

