

TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,45%	3,44%	3,48	-0,036
DE Benchmark 10Y	2,08%	2,07%	2,18	-0,099
FR Benchmark 10Y	2,59%	2,58%	2,69	-0,1017
FR Benchmark 5Y	2,43%	2,42%	2,55	-0,116
UK Benchmark 10Y	3,24%	3,23%	3,32	-0,076
TEC 10	2,4			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	75,16	76,11
Petrole Brut Brent	80,32	81,21
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,2599	3,2834
Gaz naturel	6,62	6,97
Or 1 Oc	1777,54	1777,11

DEVISES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,064	1,0636
EUR/JPY	145,835	145,828
EUR/GBP	0,87439	0,87429
EUR/CAD	1,45325	1,453
EUR/CNY	7,41972	7,41185
EUR/BRL	5,65568	5,64972

Pt de terme	EUR/USD		EUR/GBP	
	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	27,57	28,02	12,39	13,19
3 mois	71,66	72,18	35,77	36,69
6 mois	130,56	131,83	68,5	70,57

MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	1,16	1,46
Deposit EUR 1M	1,53	1,83
Deposit EUR 2M	1,72	2,02
Deposit EUR 3M	1,87	2,17
Deposit EUR 6M	2,23	2,53
Deposit EUR 12M	2,48	2,78

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	1,403	15/12/2022
EURIBOR 1W EUR	1,432	14/12/2022
EURIBOR 1M EUR	1,697	14/12/2022
EURIBOR 3M EUR	2,081	14/12/2022
EURIBOR 6M EUR	2,519	14/12/2022
EURIBOR 12M EUR	2,871	14/12/2022

	30/11/2022	31/10/2022
TMO	2,82	3,03
TME	2,62	2,83
TMM	1,4622	0,7402
EURIBOR 1M MOY MENS	1,42	0,913
EURIBOR 3M MOY MENS	1,821	1,422

COUVERTURE

COUVERTURE RISQUE DE TAUX	PRETEUR	EMPRUNTEUR
LIFFE	EURIBOR 3 M	
I DEC22	97,89	97,895
I MAR23	96,99	96,995
I JUN23	96,675	96,68
I DEC23	96,725	96,73
I MAR24	96,86	96,865

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,861	1,902
OIS EUR 3M	2,082	2,123
OIS EUR 6M	2,495	2,536
OIS EUR 1Y	2,851	2,892
OIS EUR 2Y	2,871	2,912
OIS EUR 3Y	2,741	2,782

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	2,488	2,508
FRA EUR 2x5	2,782	2,802
FRA EUR 3x6	2,984	3,004
FRA EUR 6x9	3,335	3,355
FRA EUR 9x12	3,377	3,397
FRA EUR 3x9	3,234	3,254
FRA EUR 6x12	3,408	3,428
FRA EUR 9x15	3,406	3,426
FRA EUR 12x24	3,467	3,487

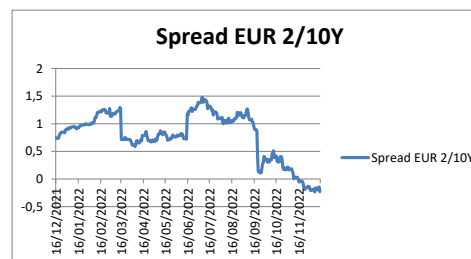
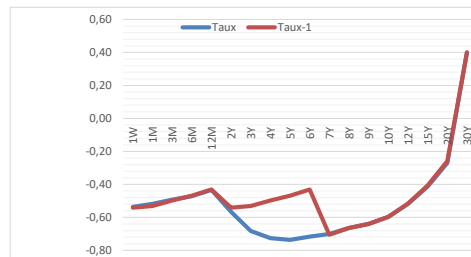
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

SWAP EURIBOR 6 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y		-0,3861
IRS EUR 2Y		-0,3924
IRS EUR 3Y		-0,3768
IRS EUR 4Y		-0,352
IRS EUR 5Y		-0,3179
IRS EUR 6Y		-0,2773
IRS EUR 7Y		-0,2313
IRS EUR 10Y		-0,0748

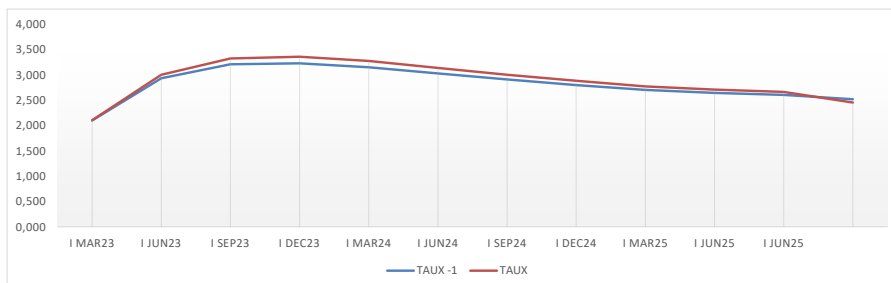
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	3,004	3,044
IRS EUR 2Y	3,07	3,11
IRS EUR 3Y	2,95	2,99
IRS EUR 4Y	2,884	2,924
IRS EUR 5Y	2,849	2,889
IRS EUR 6Y	2,814	2,854
IRS EUR 7Y	2,785	2,825
IRS EUR 10Y	2,786	2,826




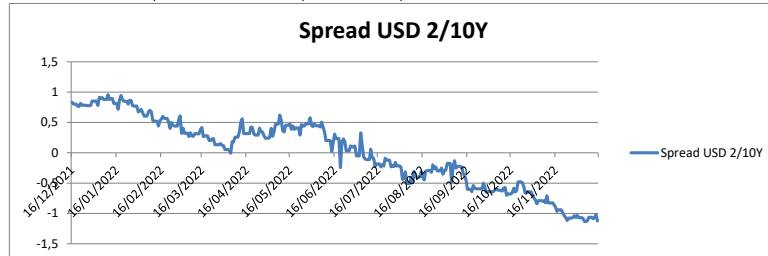
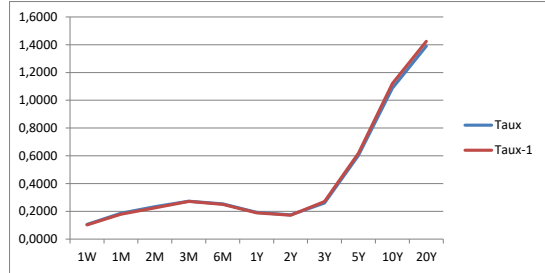
TAUX EURIBOR	14/12/2022	13/12/2022	Δ
EURIBOR 1W EUR	1,43	1,40	0,029
EURIBOR 1M EUR	1,70	1,69	0,011
EURIBOR 3M EUR	2,08	2,05	0,035
EURIBOR 6M EUR	2,52	2,48	0,040
EURIBOR 12M EUR	2,87	2,87	-0,002
	15/12/2022	14/12/2022	
XEU Benchmark 2Y	2,32	2,10	0,221
XEU Benchmark 3Y	2,15	1,91	0,240
XEU Benchmark 4Y	2,35	2,13	0,221
XEU Benchmark 5Y	2,17	1,94	0,231
XEU Benchmark 6Y	2,10	1,89	0,215
XEU Benchmark 7Y	2,09	1,90	0,195
XEU Benchmark 8Y	2,06	1,88	0,175
XEU Benchmark 9Y	2,41	2,23	0,181
XEU Benchmark 10Y	2,09	1,95	0,136
XEU Benchmark 12Y	2,75	2,59	0,156
XEU Benchmark 15Y	2,13	2,04	0,089
XEU Benchmark 20Y	2,03	1,97	0,058
TEC 30	2,60	2,57	0,030




EURIBOR3M	2,081						
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS	16/12/2022	15/12/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
I DEC22	97,895	97,9	2,105		95,790	2,100	0,024
I MAR23	96,995	97,065	3,005		93,990	2,935	0,924
I JUN23	96,675	96,79	3,325		93,350	3,210	1,244
I SEP23	96,64	96,77	3,360		93,280	3,230	1,279
I DEC23	96,725	96,85	3,275		93,450	3,150	1,194
I MAR24	96,86	96,97	3,140		93,720	3,030	1,059
I JUN24	96,995	97,09	3,005		93,990	2,910	0,924
I SEP24	97,115	97,2	2,885		94,230	2,800	0,804
I DEC24	97,225	97,295	2,775		94,450	2,705	0,694
I MAR25	97,29	97,355	2,710		94,580	2,645	0,629
I JUN25	97,335	97,395	2,665		94,670	2,605	0,584
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	0,374



TAUX US EMPRUNTEUR 				
	15/12/2022	13/12/2022	Δ	
SOFR	3,8000	3,8000	3,800	
SOFR 30 Day	3,8083	3,8073	3,807	
SOFR 90 Day	3,3484	3,3142	3,314	
SOFR 180 Day	2,6542	2,6278	2,628	
	15/12/2022	14/12/2022		
USA Benchmark 1Y	4,8918	4,8216	4,822	
US Benchmark 2Y	4,5869	4,5083	4,508	
US Benchmark 3Y	4,1395	4,0697	4,070	
US Benchmark 5Y	3,7482	3,7076	3,708	
US Benchmark 10Y	3,4619	3,4909	3,491	
US Benchmark 20Y	3,7047	3,7681	3,768	
US Benchmark 30Y	3,5032	3,5599	3,560	



TAUX UK EMPRUNTEUR 				
	13/12/2022	12/12/2022	Δ	
SONIA	2,9287	2,9289	2,9289	
LIBOR 1M GBP Synth	3,4878	3,4976	3,4976	
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,7942	3,8172	3,8172	
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,2955	4,3375	4,3375	
	15/12/2022	14/12/2022		
UK Benchmark 1Y	3,4418	3,5587	3,558707	
UK Benchmark 2Y	3,6265	3,6906	3,690583	
UK Benchmark 3Y	3,1455	3,2319	3,231856	
UK Benchmark 4Y	3,3019	3,3815	3,381496	
UK Benchmark 5Y	3,2688	3,3561	3,356094	
UK Benchmark 6Y	3,2845	3,4031	3,403077	
UK Benchmark 7Y	3,2027	3,3017	3,301683	
UK Benchmark 8Y	3,2057	3,3531	3,353138	
UK Benchmark 9Y	3,3697	3,3546	3,354552	
UK Benchmark 10Y	3,3027	3,4124	3,412434	
UK Benchmark 12Y	3,4545	3,5654	3,565415	
UK Benchmark 15Y	3,6362	3,7246	3,724611	
UK Benchmark 20Y	3,6903	3,8044	3,804401	

