

## TAUX ET MATIERES PREMIERES

LONGS ETATS	ACHAT	VENTE	ACHAT CLOSE	Δ
US Benchmark 10Y	3,88%	3,88%	3,87	0,018
DE Benchmark 10Y	2,50%	2,49%	2,48	0,012
FR Benchmark 10Y	3,05%	3,04%	3,03	0,0281
FR Benchmark 5Y	2,84%	2,83%	2,82	0,025
UK Benchmark 10Y	3,66%	3,65%	3,68	-0,024
TEC 10	3,02			

ENERGIE ET OR (USD)	Cours	Close
Petrole Brut WTI	77,43	78,96
Petrole Brut Brent	81,59	83,26
Electricity NYHubZJ	26,6	26,6
Heating oil/fuel	3,3778	3,3778
Gaz naturel	4,69	4,709
Or 1 Oc	1808,87	1802,65

## DEVICES

Parités	VENTE	ACHAT
EUR/USD	1,065	1,0647
EUR/JPY	142,316	142,304
EUR/GBP	0,88382	0,88371
EUR/CAD	1,44792	1,44763
EUR/CNY	7,41738	7,41028
EUR/BRL	5,61364	5,60611

	EUR/USD	ACHAT	EUR/GBP	ACHAT
Pt de terme	VENTE	ACHAT	VENTE	ACHAT
1 mois	23,25	23,5	11,9	12,48
3 mois	66,77	67,17	35,53	36,45
6 mois	123,64	124,49	68,22	70,1

## MARCHE MONETAIRE

MARCHE MONETAIRE EUR	VENTE	ACHAT
Deposit EUR ON	1,61	1,91
Deposit EUR 1M	1,7	2
Deposit EUR 2M	1,88	2,18
Deposit EUR 3M	2,01	2,31
Deposit EUR 6M	2,48	2,78
Deposit EUR 12M	2,92	3,22

FIXING	TAUX	DATE
ECB ESTR Short Term	1,906	28/12/2022
EURIBOR 1W EUR	1,885	27/12/2022
EURIBOR 1M EUR	1,895	27/12/2022
EURIBOR 3M EUR	2,128	27/12/2022
EURIBOR 6M EUR	2,703	27/12/2022
EURIBOR 12M EUR	3,265	27/12/2022

	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		
I MAR23	97,015	97,02
I JUN23	96,45	96,455
I DEC23	96,45	96,455
I MAR24	96,605	96,61

SWAP ESTER	PRETEUR	EMPRUNTEUR
OIS EUR 1M	1,885	1,926
OIS EUR 3M	2,22	2,261
OIS EUR 6M	2,613	2,654
OIS EUR 1Y	3,036	3,077
OIS EUR 2Y	3,074	3,115
OIS EUR 3Y	2,963	3,004

FRA's	PRETEUR	EMPRUNTEUR
FRA EUR 1x4	2,527	2,547
FRA EUR 2x5	2,825	2,845
FRA EUR 3x6	3,086	3,106
FRA EUR 6x9	3,545	3,565
FRA EUR 9x12	3,6	3,62
FRA EUR 3x9	3,369	3,389
FRA EUR 6x12	3,63	3,65
FRA EUR 9x15	3,63	3,65
FRA EUR 12x24	3,44	3,46

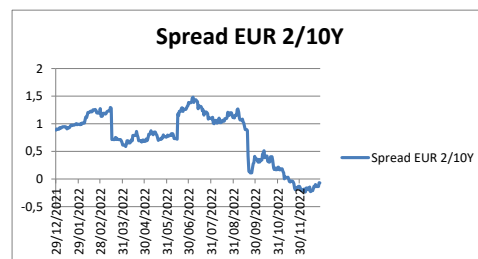
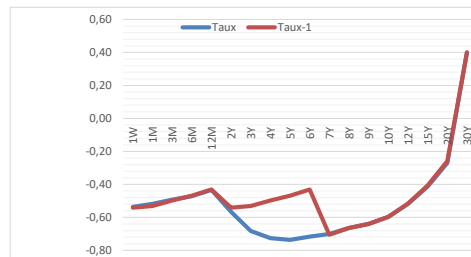
SWAP EURIBOR 1 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 3M	-0,473	-0,453
IRS EUR 6M	-0,481	-0,461
IRS EUR 1Y	-0,491	-0,471
IRS 2Y Ac/360v1M FI	-0,504	-0,484
IRS 3Y Ac/360v1M FI	-0,511	-0,491

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

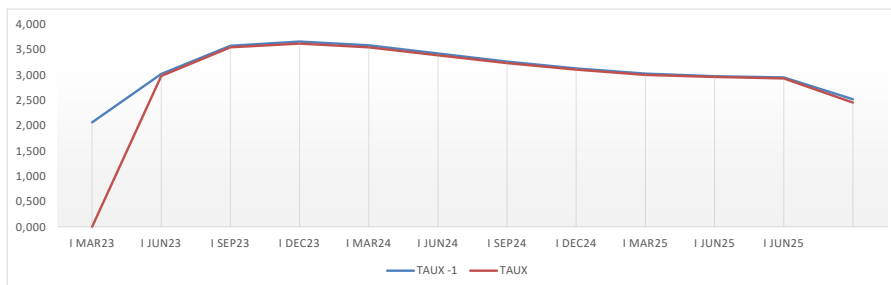
SWAP EURIBOR 3 MOIS	PRETEUR	EMPRUNTEUR
IRS EUR 1Y	3,172	3,212
IRS EUR 2Y	3,266	3,306
IRS EUR 3Y	3,165	3,205
IRS EUR 4Y	3,112	3,152
IRS EUR 5Y	3,091	3,131
IRS EUR 6Y	3,076	3,116
IRS EUR 7Y	3,066	3,106
IRS EUR 10Y	3,092	3,132



	27/12/2022	23/12/2022	Δ
TAUX EURIBOR			
EURIBOR 1W EUR	1,89	1,89	0,000
EURIBOR 1M EUR	1,90	1,91	-0,015
EURIBOR 3M EUR	2,13	2,14	-0,013
EURIBOR 6M EUR	2,70	2,70	0,002
EURIBOR 12M EUR	3,27	3,24	0,027
	28/12/2022	27/12/2022	
XEU Benchmark 2Y	2,57	2,59	-0,015
XEU Benchmark 3Y	2,45	2,47	-0,023
XEU Benchmark 4Y	2,77	2,76	0,009
XEU Benchmark 5Y	2,52	2,54	-0,022
XEU Benchmark 6Y	2,47	2,49	-0,020
XEU Benchmark 7Y	2,47	2,49	-0,016
XEU Benchmark 8Y	2,45	2,47	-0,018
XEU Benchmark 9Y	2,87	2,86	0,009
XEU Benchmark 10Y	2,51	2,52	-0,016
XEU Benchmark 12Y	3,18	3,19	-0,002
XEU Benchmark 15Y	2,59	2,61	-0,020
XEU Benchmark 20Y	2,52	2,54	-0,019
TEC 30	3,16	3,16	0,000

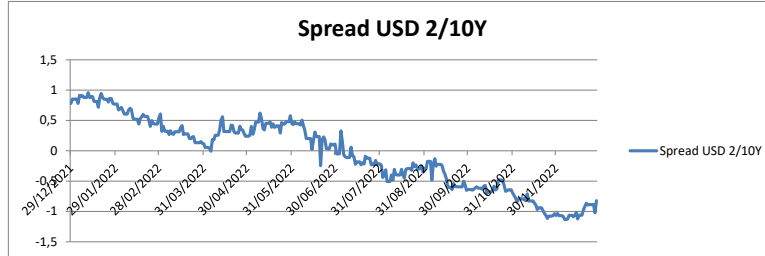
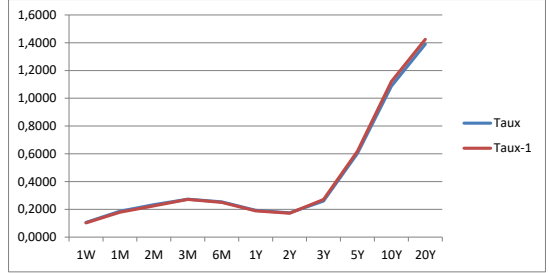


EURIBOR3M	2,128						
EURIBOR 3M EUR	19/12/2022	19/12/2022	TAUX	Δ	TAUX VEILLE	Δ/FIX	
LIFFE EURIBOR3M/ROLLS			#VALEUR!		#VALEUR!		#VALEUR!
I DEC22		97,937	2,980		2,063		0,852
I MAR23	97,02	96,98	2,980		94,040	3,020	0,852
I JUN23	96,455	96,425	3,545		92,910	3,575	1,417
I SEP23	96,38	96,34	3,620		92,760	3,660	1,492
I DEC23	96,455	96,415	3,545		92,910	3,585	1,417
I MAR24	96,61	96,575	3,390		93,220	3,425	1,262
I JUN24	96,765	96,735	3,235		93,530	3,265	1,107
I SEP24	96,895	96,87	3,105		93,790	3,130	0,977
I DEC24	97	96,975	3,000		94,000	3,025	0,872
I MAR25	97,04	97,025	2,960		94,080	2,975	0,832
I JUN25	97,07	97,05	2,930		94,140	2,950	0,802
I JUN25	97,545	97,48	2,455		95,090	2,520	0,327



**TAUX US EMPRUNTEUR** 

	28/12/2022	23/12/2022	Δ
SOFR	4,3000	4,3000	4,300
SOFR 30 Day	4,0286	3,9444	3,944
SOFR 90 Day	3,5891	3,5155	3,515
SOFR 180 Day	2,8619	2,7830	2,783
	<b>28/12/2022</b>	<b>27/12/2022</b>	
USA Benchmark 1Y	4,8503	4,8493	4,849
US Benchmark 2Y	4,7081	4,8454	4,845
US Benchmark 3Y	4,3452	4,4072	4,407
US Benchmark 5Y	4,0319	3,9709	3,971
US Benchmark 10Y	3,8849	3,8225	3,823
US Benchmark 20Y	4,1781	4,1178	4,118
US Benchmark 30Y	4,0019	3,9372	3,937



**TAUX UK EMPRUNTEUR** 

	23/12/2022	22/12/2022	Δ
SONIA	3,4281	3,4275	3,4275
LIBOR 1M GBP Synth	3,4690	3,4623	3,4623
LIBOR 3M/ GBP Synt	3,8095	3,8035	3,8035
LIBOR 6M/ GBP Synt	4,3413	4,3117	4,3117
	<b>28/12/2022</b>	<b>27/12/2022</b>	
UK Benchmark 1Y	3,7256	3,8965	3,896512
UK Benchmark 2Y	4,0042	4,0161	4,01606
UK Benchmark 3Y	3,6135	3,7039	3,703933
UK Benchmark 4Y	3,7166	3,7245	3,724459
UK Benchmark 5Y	3,7068	3,7008	3,700805
UK Benchmark 6Y	3,7647	3,7788	3,778751
UK Benchmark 7Y	3,6582	3,6217	3,621697
UK Benchmark 8Y	3,6794	3,6755	3,675534
UK Benchmark 9Y	3,8081	3,7288	3,728842
UK Benchmark 10Y	3,7585	3,7041	3,704147
UK Benchmark 12Y	3,9417	4,1740	4,174013
UK Benchmark 15Y	4,0187	3,9746	3,974584
UK Benchmark 20Y	4,1058	4,1034	4,103408

