

Treasury update

woensdag 23 augustus 2017 12:55

Euribor - rates

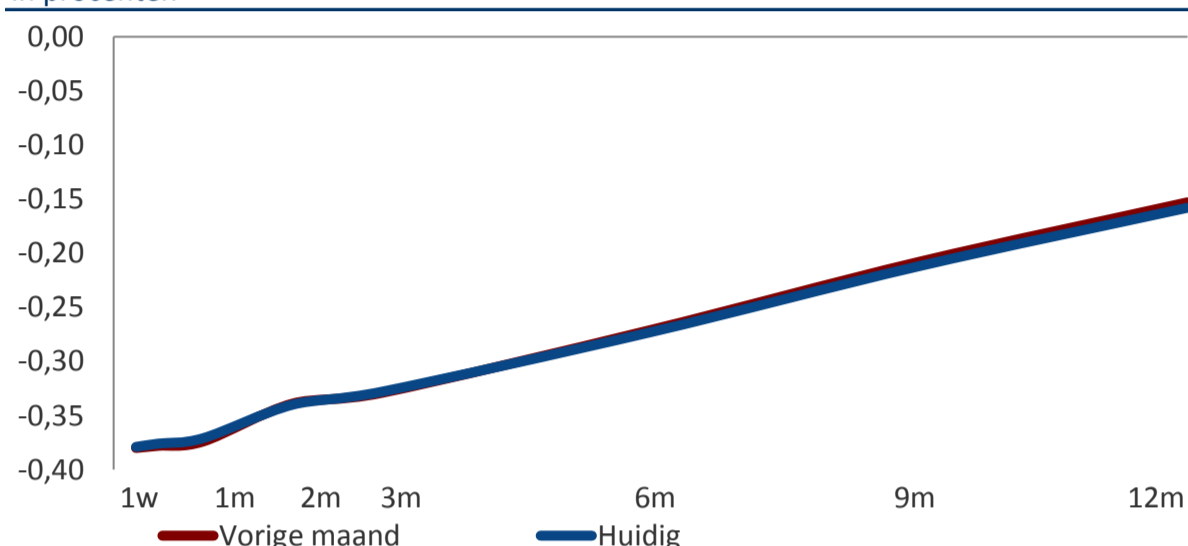
termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,38	-0,38
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,33	-0,33
6 maanden	-0,27	-0,27
9 maanden	-0,21	-0,21
12 maanden	-0,16	-0,15

EONIA - rates

termijn	huidig	vorige mnd
1 dag	-0,36	-0,36

Euribor - curve

in procenten

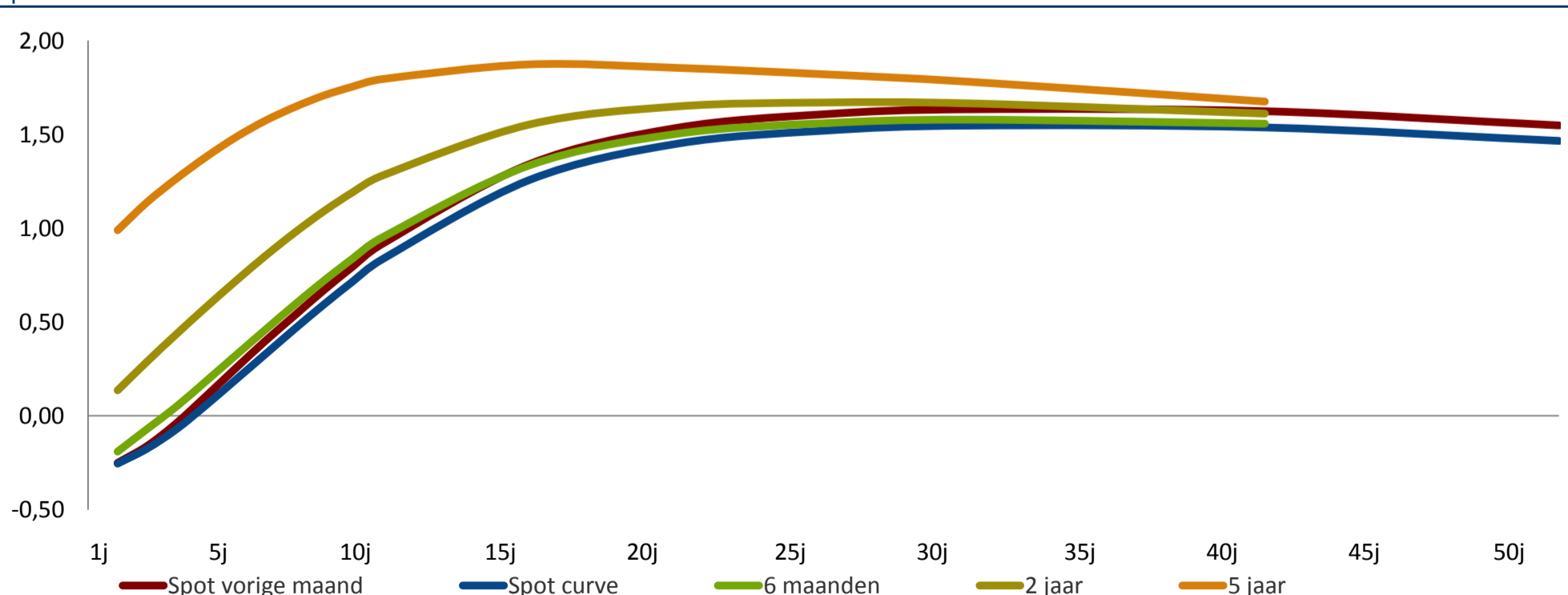


IRS - spot and forwards

termijn	spot	3 mnd	6 mnd	1 jaar	2 jaar	3 jaar	4 jaar	5 jaar	spot vorige mnd
1 jaar	-0,25	-0,23	-0,19	-0,09	0,14	0,43	0,72	0,99	-0,25
2 jaar	-0,17	-0,12	-0,07	0,02	0,29	0,58	0,87	1,14	-0,16
3 jaar	-0,07	-0,01	0,05	0,16	0,44	0,72	1,00	1,26	-0,04
4 jaar	0,06	0,12	0,18	0,31	0,58	0,86	1,13	1,38	0,10
5 jaar	0,19	0,26	0,32	0,45	0,72	0,99	1,25	1,48	0,25
6 jaar	0,33	0,39	0,46	0,58	0,85	1,11	1,36	1,57	0,40
7 jaar	0,46	0,53	0,59	0,72	0,97	1,23	1,45	1,64	0,53
8 jaar	0,59	0,66	0,72	0,84	1,09	1,32	1,53	1,71	0,67
9 jaar	0,72	0,78	0,84	0,96	1,19	1,41	1,60	1,76	0,80
10 jaar	0,84	0,89	0,95	1,06	1,28	1,48	1,65	1,79	0,92
15 jaar	1,26	1,30	1,34	1,41	1,55	1,68	1,79	1,87	1,34
20 jaar	1,45	1,48	1,50	1,55	1,65	1,73	1,80	1,85	1,53
25 jaar	1,52	1,54	1,56	1,60	1,67	1,73	1,78	1,82	1,61
30 jaar	1,55	1,56	1,58	1,61	1,67	1,71	1,75	1,78	1,63
40 jaar	1,54	1,55	1,56	1,58	1,61	1,64	1,66	1,68	1,62
50 jaar	1,47								1,55

IRS - spot and forward curve

in procenten



Treasury update

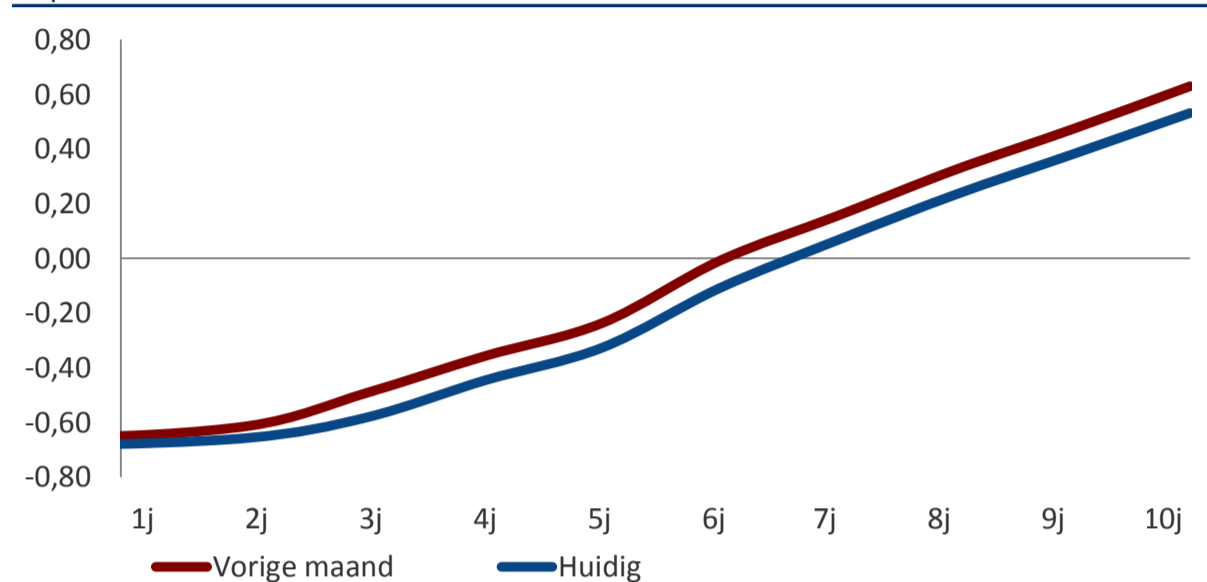
woensdag 23 augustus 2017 12:55

Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-0,64	-0,57
6 maanden	-0,68	-0,65
2 jaar	-0,66	-0,61
3 jaar	-0,58	-0,49
4 jaar	-0,45	-0,36
5 jaar	-0,33	-0,24
6 jaar	-0,11	-0,01
7 jaar	0,07	0,16
8 jaar	0,23	0,32
9 jaar	0,38	0,47
10 jaar	0,53	0,63
20 jaar	0,93	1,04
30 jaar	1,22	1,34

Staatsobligaties NL - curve

in procenten



Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	07 sep 17
BOE (UK)	0,25	14 sep 17
FED (US)	1,25	20 sep 17
BOJ (JPN)	-0,10	21 sep 17
RBA (AUS)	1,50	05 sep 17

Valutamarkt (euro)

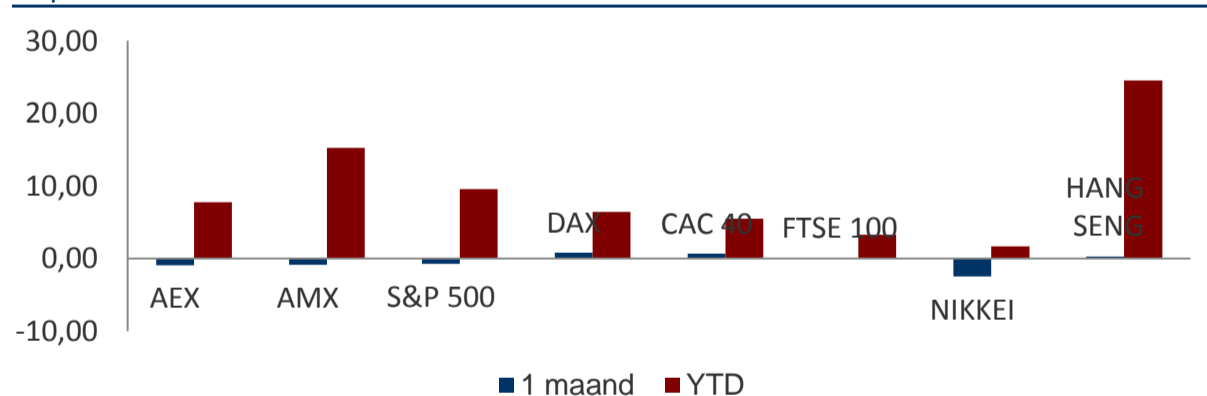
valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,18	1,16	NOK (kr)	9,30	9,32
GBP (£)	0,92	0,89	HKD (\$)	9,22	9,09
CHF (CHF)	1,14	1,10	NZD (\$)	1,63	1,57
JPY (¥)	128,87	129,35	AUD (\$)	1,49	1,47
SEK (kr)	9,54	9,57	CAD (\$)	1,48	1,46

Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	520,7	-0,91%
AMX	792,3	-0,83%
S&P 500	2452,5	-0,72%
DAX	12220,3	0,84%
CAC 40	5129,3	0,70%
FTSE 100	7379,0	0,10%
NIKKEI	19434,6	-2,46%
HANG SENG	27401,7	0,28%

Aandelenmarkten verschil

in procenten



10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,40
Frankrijk (FR)	0,71
België (BE)	0,72
Groot Britannië (GB)	1,08
Zwitserland (CH)	-0,13
Spanje (ES)	1,59
Griekenland (GR)	5,57
Italië (IT)	2,14
Portugal (PT)	2,82
Zweden (SE)	0,64
Verenigde Staten (VS)	2,21
Japan (JP)	0,04
China (CN)	3,67

10-Jaars staatsobligaties buitenland

in procenten

