

# Treasury update

maandag 23 april 2018 9:46

## Euribor - rates

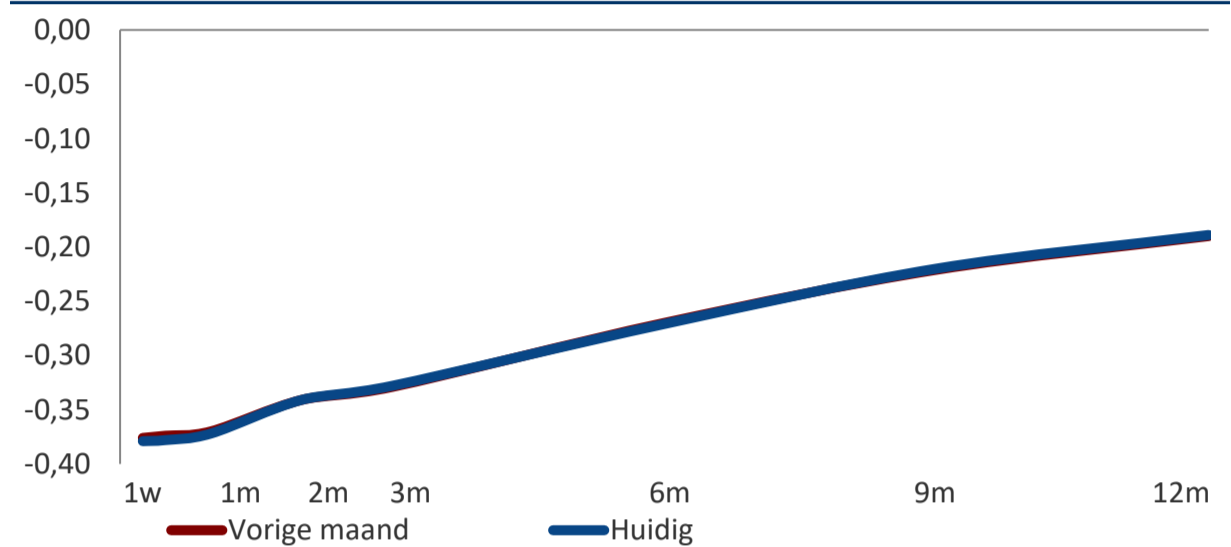
termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,38	-0,37
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,33	-0,33
6 maanden	-0,27	-0,27
9 maanden	-0,22	-0,22
12 maanden	-0,19	-0,19

## EONIA - rates

termijn	huidig	vorige mnd
1 dag	-0,37	-0,37

## Euribor - curve

in procenten

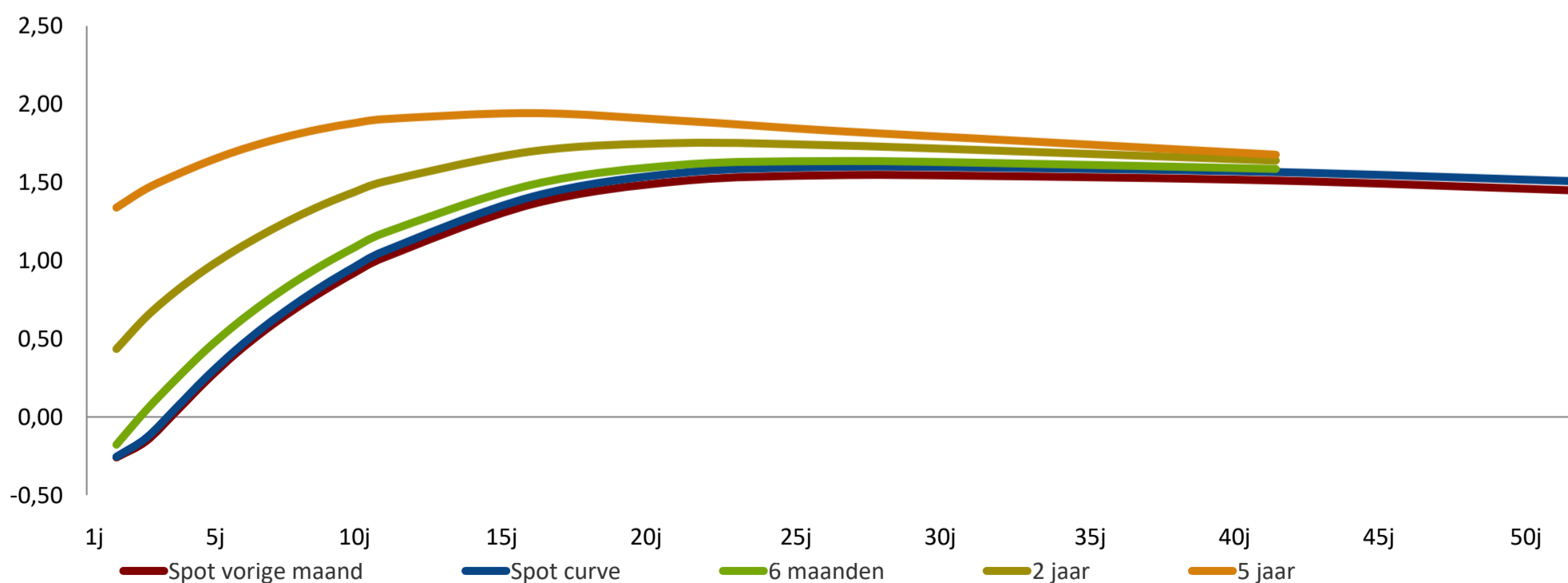


## IRS - spot and forwards

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	-0,18	-0,01	0,43	0,83	1,12	1,34	-0,26
2 jaar	-0,13	-0,05	0,04	0,21	0,64	0,98	1,25	1,46	-0,15
3 jaar	0,06	0,15	0,24	0,42	0,80	1,11	1,35	1,55	0,03
4 jaar	0,25	0,34	0,43	0,60	0,94	1,22	1,44	1,63	0,23
5 jaar	0,43	0,51	0,59	0,75	1,07	1,32	1,53	1,70	0,40
6 jaar	0,58	0,66	0,73	0,88	1,17	1,41	1,60	1,76	0,56
7 jaar	0,72	0,79	0,86	1,00	1,27	1,49	1,67	1,80	0,69
8 jaar	0,85	0,91	0,98	1,11	1,36	1,56	1,72	1,85	0,81
9 jaar	0,96	1,02	1,08	1,21	1,44	1,62	1,77	1,88	0,92
10 jaar	1,06	1,12	1,18	1,29	1,50	1,67	1,80	1,90	1,02
15 jaar	1,41	1,45	1,49	1,56	1,70	1,80	1,88	1,94	1,36
20 jaar	1,56	1,59	1,61	1,66	1,75	1,82	1,86	1,89	1,51
25 jaar	1,60	1,62	1,64	1,67	1,74	1,78	1,81	1,83	1,54
30 jaar	1,60	1,61	1,63	1,65	1,71	1,74	1,77	1,78	1,54
40 jaar	1,57	1,58	1,59	1,61	1,64	1,66	1,67	1,68	1,51
50 jaar	1,51								1,45

## IRS - spot and forward curve

in procenten



# Treasury update

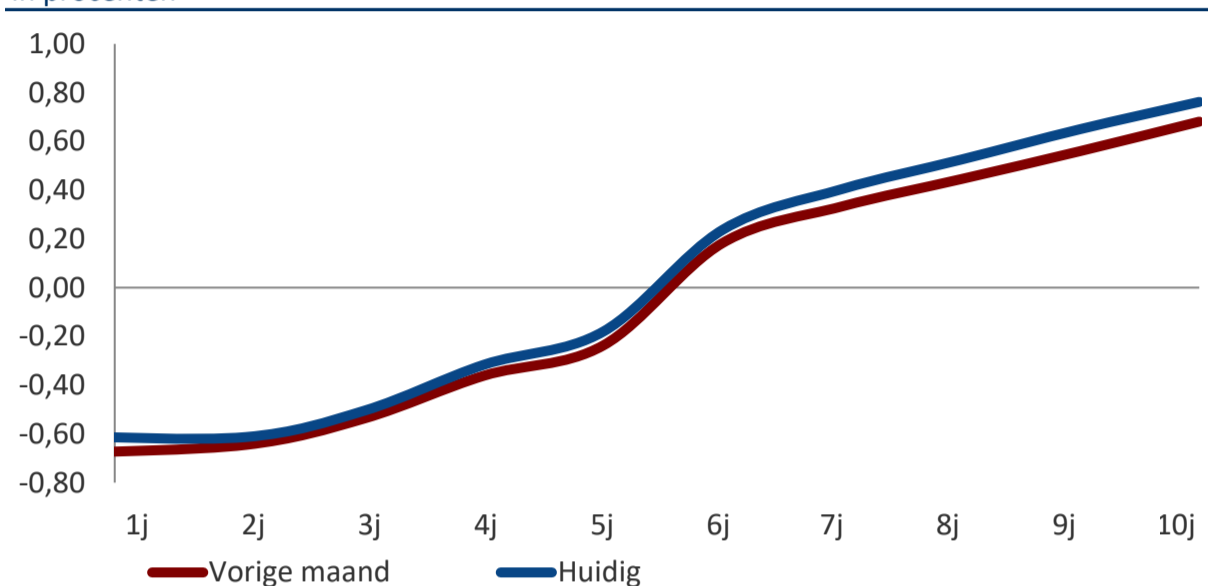
maandag 23 april 2018 9:46

## Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-0,61	-0,70
6 maanden	-0,61	-0,68
2 jaar	-0,61	-0,65
3 jaar	-0,50	-0,54
4 jaar	-0,32	-0,36
5 jaar	-0,18	-0,24
6 jaar	0,24	0,18
7 jaar	0,40	0,33
8 jaar	0,53	0,45
9 jaar	0,65	0,56
10 jaar	0,76	0,68
20 jaar	1,05	0,95
30 jaar	1,27	1,15

## Staatsobligaties NL - curve

in procenten



## Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	26 apr 18
BOE (UK)	0,50	10 mei 18
FED (US)	1,75	02 mei 18
BOJ (JPN)	-0,10	27 apr 18
RBA (AUS)	1,50	01 mei 18

## Valutamarkt (euro)

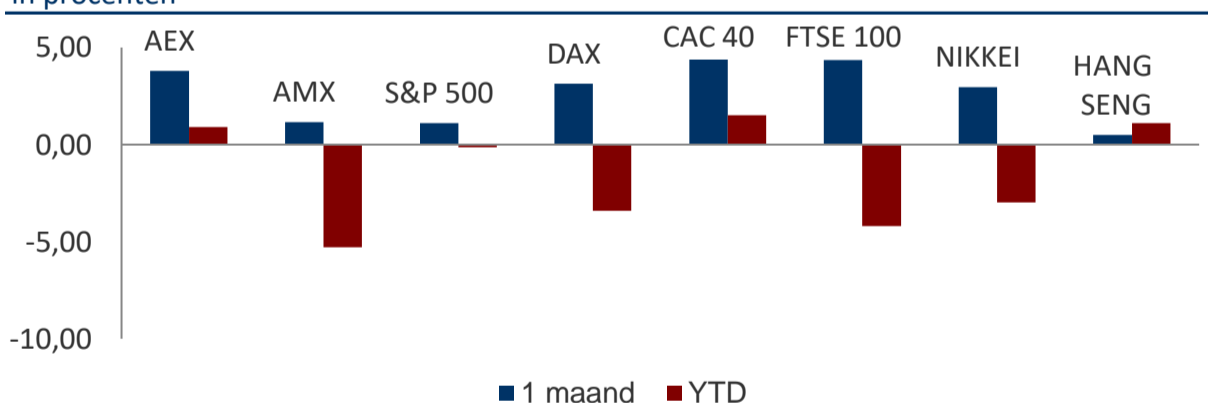
valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,23	1,24	NOK (kr)	9,63	9,58
GBP (£)	0,88	0,87	HKD (\$)	9,62	9,61
CHF (CHF)	1,20	1,17	NZD (\$)	1,71	1,71
JPY (¥)	132,41	129,40	AUD (\$)	1,60	1,60
SEK (kr)	10,39	10,19	CAD (\$)	1,57	1,59

## Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	549,6	3,78%
AMX	790,5	1,16%
S&P 500	2670,1	1,11%
DAX	12476,5	3,14%
CAC 40	5393,3	4,37%
FTSE 100	7364,7	4,37%
NIKKEI	22088,0	2,95%
HANG SENG	30246,6	0,51%

## Aandelenmarkten verschil

in procenten



## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,62
Frankrijk (FR)	0,84
België (BE)	0,87
Groot-Britannië (GB)	1,50
Zwitserland (CH)	0,14
Spanje (ES)	1,30
Griekenland (GR)	4,04
Italië (IT)	1,79
Portugal (PT)	1,68
Zweden (SE)	0,77
Verenigde Staten (VS)	2,98
Japan (JP)	0,07
China (CN)	3,55

## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

in procenten

