

Treasury update

woensdag 28 juni 2017 12:55

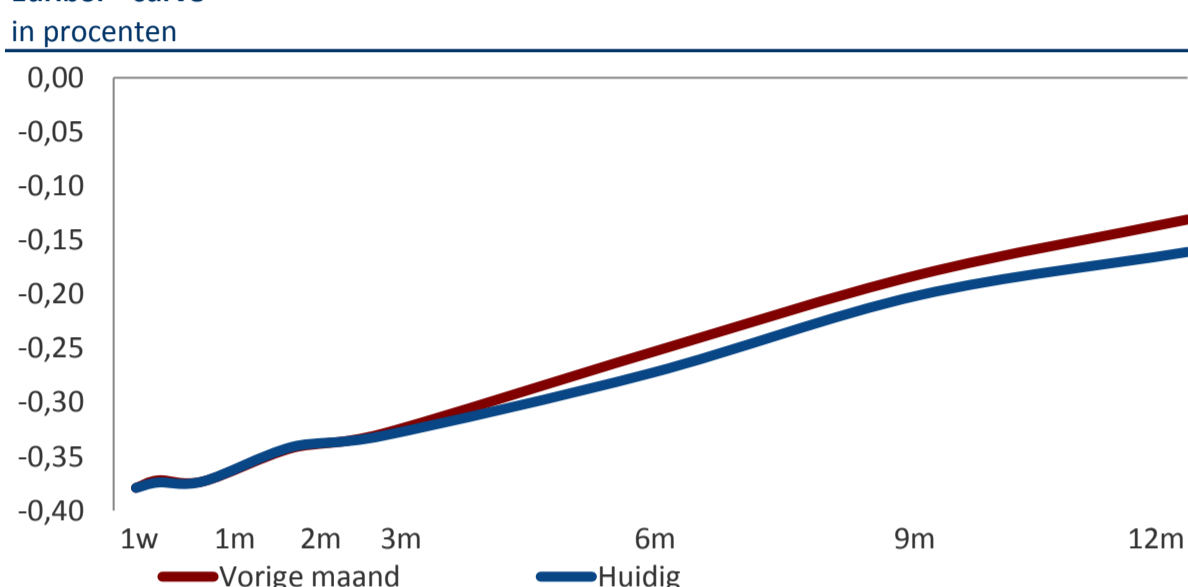
Euribor - rates

termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,37	-0,37
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,33	-0,33
6 maanden	-0,27	-0,25
9 maanden	-0,20	-0,18
12 maanden	-0,16	-0,13

EONIA - rates

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

Euribor - curve

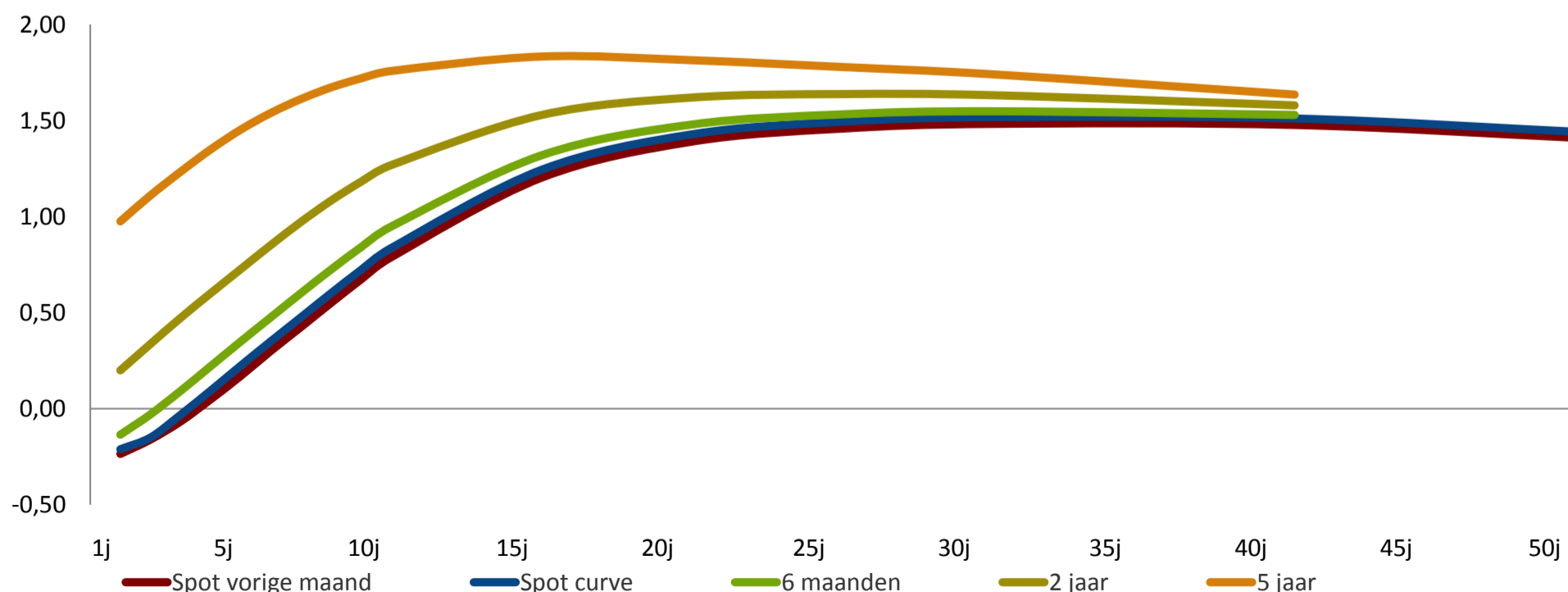


IRS - spot and forwards

termijn	spot	3 mnd	6 mnd	1 jaar	2 jaar	3 jaar	4 jaar	5 jaar	spot vorige mnd
1 jaar	-0,21	-0,21	-0,14	-0,08	0,20	0,47	0,74	0,97	-0,24
2 jaar	-0,15	-0,10	-0,03	0,06	0,34	0,61	0,87	1,11	-0,16
3 jaar	-0,03	0,02	0,09	0,20	0,47	0,74	0,99	1,23	-0,07
4 jaar	0,09	0,15	0,22	0,33	0,60	0,86	1,11	1,35	0,05
5 jaar	0,22	0,28	0,35	0,46	0,73	0,98	1,23	1,45	0,17
6 jaar	0,35	0,41	0,48	0,59	0,85	1,10	1,33	1,54	0,30
7 jaar	0,48	0,54	0,60	0,72	0,97	1,21	1,43	1,61	0,43
8 jaar	0,60	0,66	0,72	0,84	1,08	1,31	1,50	1,67	0,55
9 jaar	0,72	0,78	0,84	0,95	1,18	1,39	1,57	1,72	0,67
10 jaar	0,84	0,89	0,95	1,05	1,27	1,46	1,62	1,76	0,79
15 jaar	1,24	1,28	1,32	1,39	1,53	1,65	1,75	1,83	1,20
20 jaar	1,43	1,45	1,48	1,53	1,62	1,70	1,76	1,81	1,39
25 jaar	1,49	1,51	1,53	1,57	1,64	1,70	1,74	1,78	1,46
30 jaar	1,52	1,53	1,55	1,58	1,63	1,68	1,71	1,74	1,48
40 jaar	1,51	1,52	1,53	1,55	1,58	1,60	1,62	1,63	1,48
50 jaar	1,44								1,41

IRS - spot and forward curve

in procenten



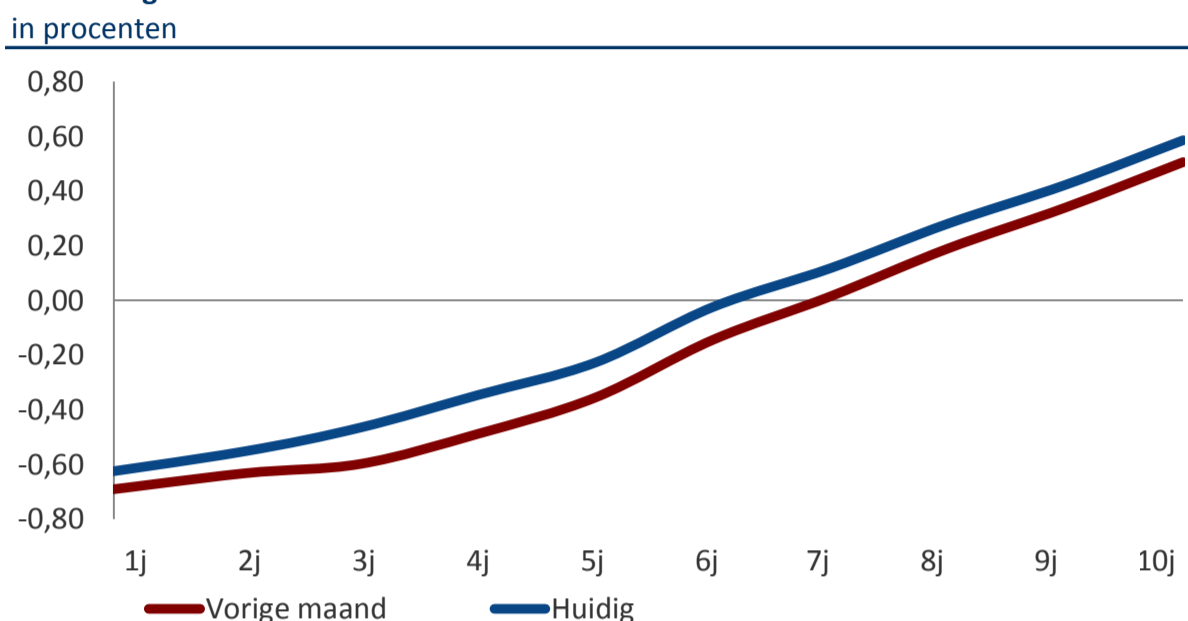
Treasury update

woensdag 28 juni 2017 12:55

Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-0,67	-0,70
6 maanden	-0,65	-0,71
2 jaar	-0,55	-0,63
3 jaar	-0,47	-0,60
4 jaar	-0,35	-0,49
5 jaar	-0,23	-0,36
6 jaar	-0,02	-0,14
7 jaar	0,12	0,02
8 jaar	0,28	0,19
9 jaar	0,42	0,34
10 jaar	0,59	0,51
20 jaar	0,95	0,90
30 jaar	1,22	1,19

Staatsobligaties NL - curve



Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	20 jul 17
BOE (UK)	0,25	03 aug 17
FED (US)	1,25	26 jul 17
BOJ (JPN)	-0,10	20 jul 17
RBA (AUS)	1,50	04 jul 17

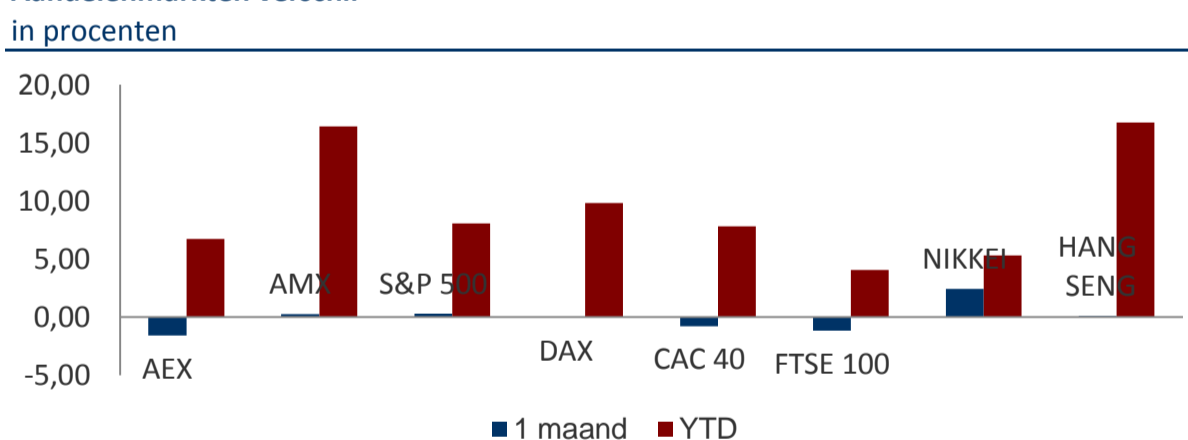
Valutamarkt (euro)

valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,14	1,12	NOK (kr)	9,59	9,43
GBP (£)	0,89	0,87	HKD (\$)	8,87	8,72
CHF (CHF)	1,09	1,09	NZD (\$)	1,56	1,58
JPY (¥)	127,44	123,99	AUD (\$)	1,50	1,50
SEK (kr)	9,77	9,76	CAD (\$)	1,49	1,51

Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	515,7	-1,60%
AMX	800,1	0,23%
S&P 500	2419,4	0,31%
DAX	12609,0	-0,05%
CAC 40	5242,0	-0,79%
FTSE 100	7432,9	-1,16%
NIKKEI	20130,4	2,44%
HANG SENG	25683,5	0,09%

Aandelenmarkten verschil



10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,38
Frankrijk (FR)	0,73
België (BE)	0,71
Groot Britannië (GB)	1,14
Zwitserland (CH)	-0,09
Spanje (ES)	1,45
Griekenland (GR)	5,51
Italië (IT)	2,06
Portugal (PT)	3,03
Zweden (SE)	0,55
Verenigde Staten (VS)	2,25
Japan (JP)	0,06
China (CN)	3,53

10-Jaars staatsobligaties buitenland

