

Treasury update

dinsdag 20 februari 2018 9:25

Euribor - rates

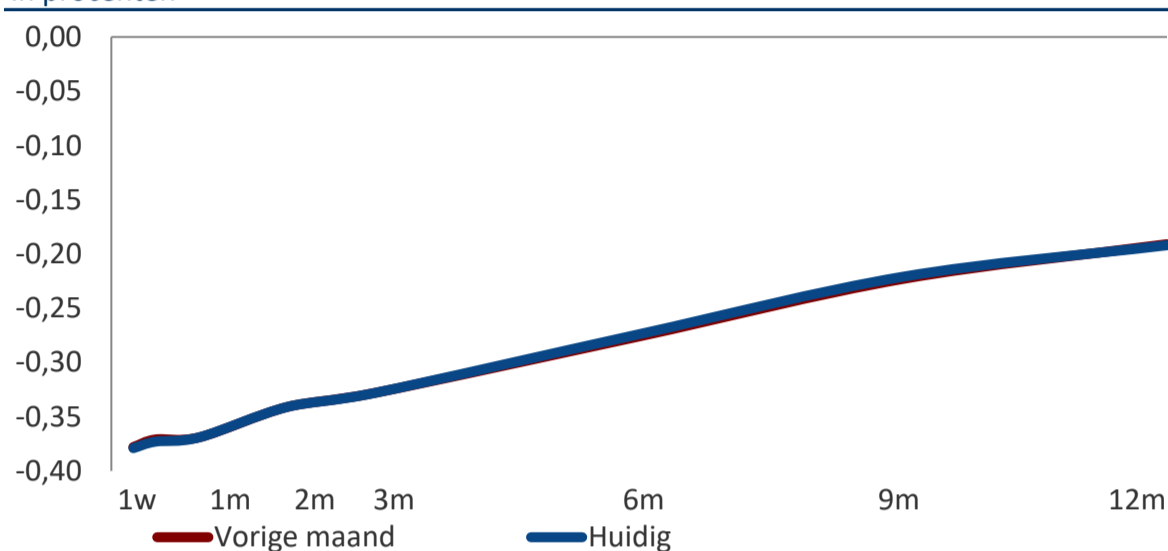
termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,37	-0,37
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,33	-0,33
6 maanden	-0,27	-0,28
9 maanden	-0,22	-0,22
12 maanden	-0,19	-0,19

EONIA - rates

termijn	huidig	vorige mnd
1 dag	-0,37	-0,36

Euribor - curve

in procenten

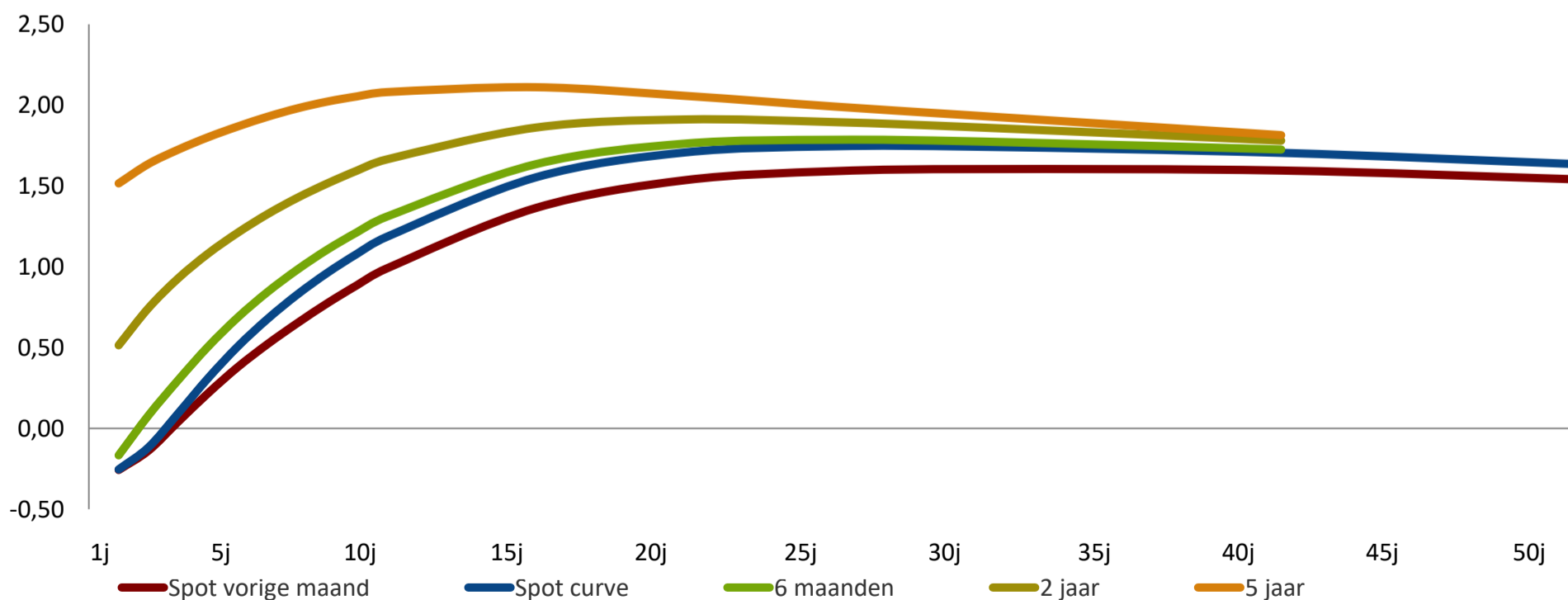


IRS - spot and forwards

termijn	spot	3 mnd	6 mnd	1 jaar	2 jaar	3 jaar	4 jaar	5 jaar	spot vorige mnd
1 jaar	-0,25	-0,21	-0,17	0,02	0,51	0,95	1,28	1,52	-0,26
2 jaar	-0,12	-0,02	0,08	0,27	0,74	1,13	1,42	1,64	-0,14
3 jaar	0,09	0,20	0,30	0,50	0,93	1,27	1,52	1,72	0,04
4 jaar	0,31	0,41	0,51	0,70	1,08	1,38	1,62	1,80	0,22
5 jaar	0,51	0,60	0,69	0,87	1,21	1,49	1,70	1,87	0,38
6 jaar	0,68	0,76	0,85	1,01	1,33	1,58	1,77	1,93	0,52
7 jaar	0,83	0,91	0,98	1,14	1,43	1,66	1,84	1,98	0,65
8 jaar	0,96	1,03	1,11	1,25	1,52	1,73	1,89	2,02	0,77
9 jaar	1,08	1,15	1,21	1,35	1,60	1,79	1,94	2,05	0,89
10 jaar	1,19	1,25	1,31	1,44	1,66	1,84	1,98	2,08	0,99
15 jaar	1,55	1,59	1,63	1,72	1,86	1,97	2,05	2,11	1,36
20 jaar	1,71	1,73	1,76	1,82	1,91	1,98	2,03	2,06	1,54
25 jaar	1,75	1,77	1,79	1,83	1,89	1,94	1,97	1,99	1,59
30 jaar	1,74	1,76	1,77	1,81	1,86	1,90	1,92	1,93	1,60
40 jaar	1,70	1,72	1,73	1,75	1,78	1,80	1,81	1,81	1,60
50 jaar	1,63								1,54

IRS - spot and forward curve

in procenten



Treasury update

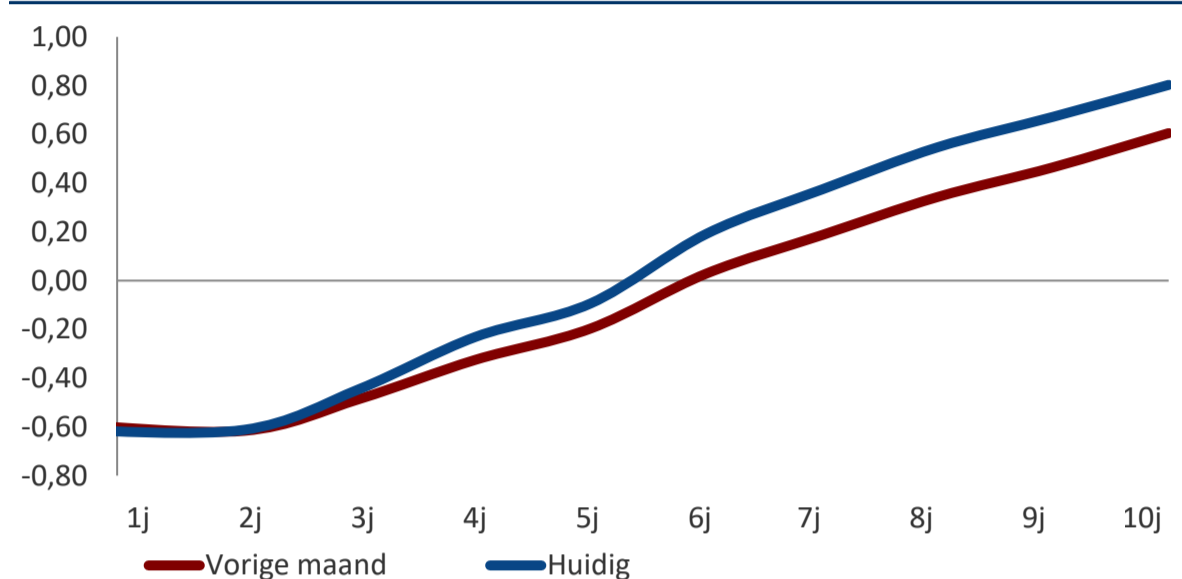
dinsdag 20 februari 2018 9:25

Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-0,58	-0,59
6 maanden	-0,61	-0,59
2 jaar	-0,61	-0,62
3 jaar	-0,44	-0,49
4 jaar	-0,23	-0,33
5 jaar	-0,09	-0,20
6 jaar	0,19	0,03
7 jaar	0,37	0,19
8 jaar	0,55	0,34
9 jaar	0,67	0,47
10 jaar	0,80	0,61
20 jaar	1,20	1,03
30 jaar	1,42	1,32

Staatsobligaties NL - curve

in procenten



Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	08 mrt 18
BOE (UK)	0,50	22 mrt 18
FED (US)	1,50	21 mrt 18
BOJ (JPN)	-0,10	09 mrt 18
RBA (AUS)	1,50	06 mrt 18

Valutamarkt (euro)

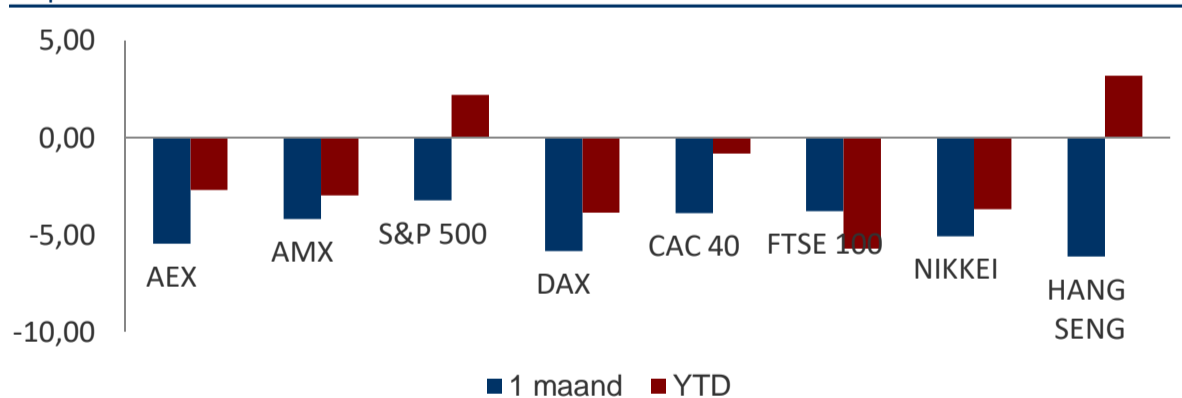
valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,24	1,22	NOK (kr)	9,66	9,61
GBP (£)	0,89	0,88	HKD (\$)	9,67	9,55
CHF (CHF)	1,15	1,18	NZD (\$)	1,68	1,68
JPY (¥)	132,32	135,45	AUD (\$)	1,56	1,53
SEK (kr)	9,91	9,84	CAD (\$)	1,56	1,53

Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	529,9	-5,46%
AMX	810,0	-4,19%
S&P 500	2732,2	-3,24%
DAX	12419,4	-5,84%
CAC 40	5268,4	-3,90%
FTSE 100	7247,9	-3,79%
NIKKEI	21925,1	-5,08%
HANG SENG	30873,6	-6,12%

Aandelenmarkten verschil

in procenten



10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,75
Frankrijk (FR)	1,01
België (BE)	1,04
Groot Britannië (GB)	1,63
Zwitserland (CH)	0,19
Spanje (ES)	1,52
Griekenland (GR)	4,28
Italië (IT)	2,05
Portugal (PT)	2,04
Zweden (SE)	0,95
Verenigde Staten (VS)	2,92
Japan (JP)	0,07
China (CN)	3,89

10-Jaars staatsobligaties buitenland

in procenten

