

Treasury update

woensdag 18 oktober 2017 9:25

Euribor - rates

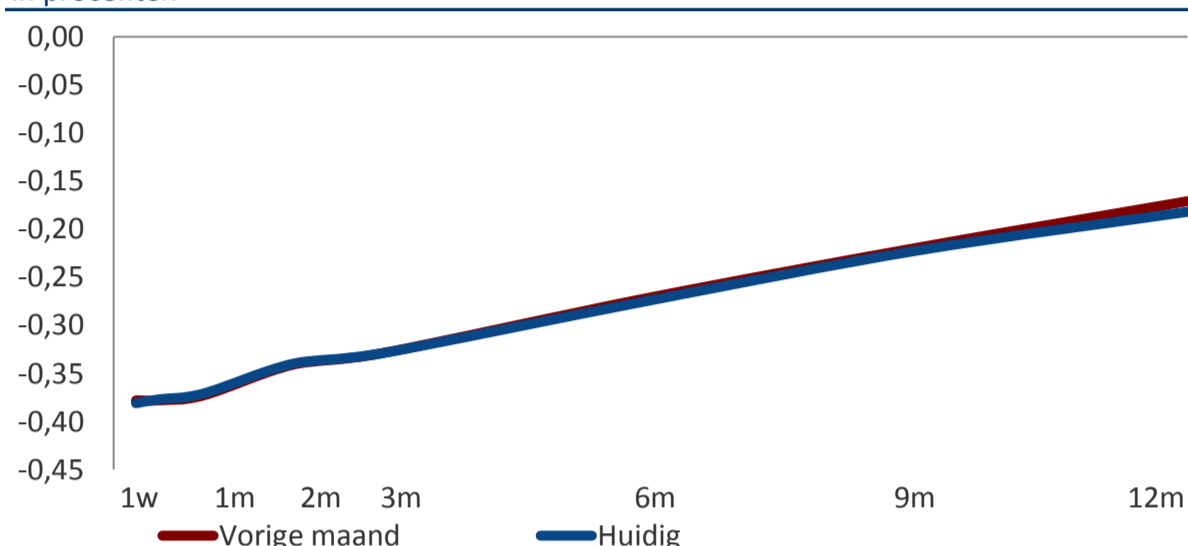
| termijn | huidig | vorige mnd |
|------------|--------|------------|
| 1 week | -0,38 | -0,38 |
| 2 weken | -0,38 | -0,38 |
| 1 maand | -0,37 | -0,37 |
| 2 maanden | -0,34 | -0,34 |
| 3 maanden | -0,33 | -0,33 |
| 6 maanden | -0,27 | -0,27 |
| 9 maanden | -0,22 | -0,22 |
| 12 maanden | -0,18 | -0,17 |

EONIA - rates

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

Euribor - curve

in procenten

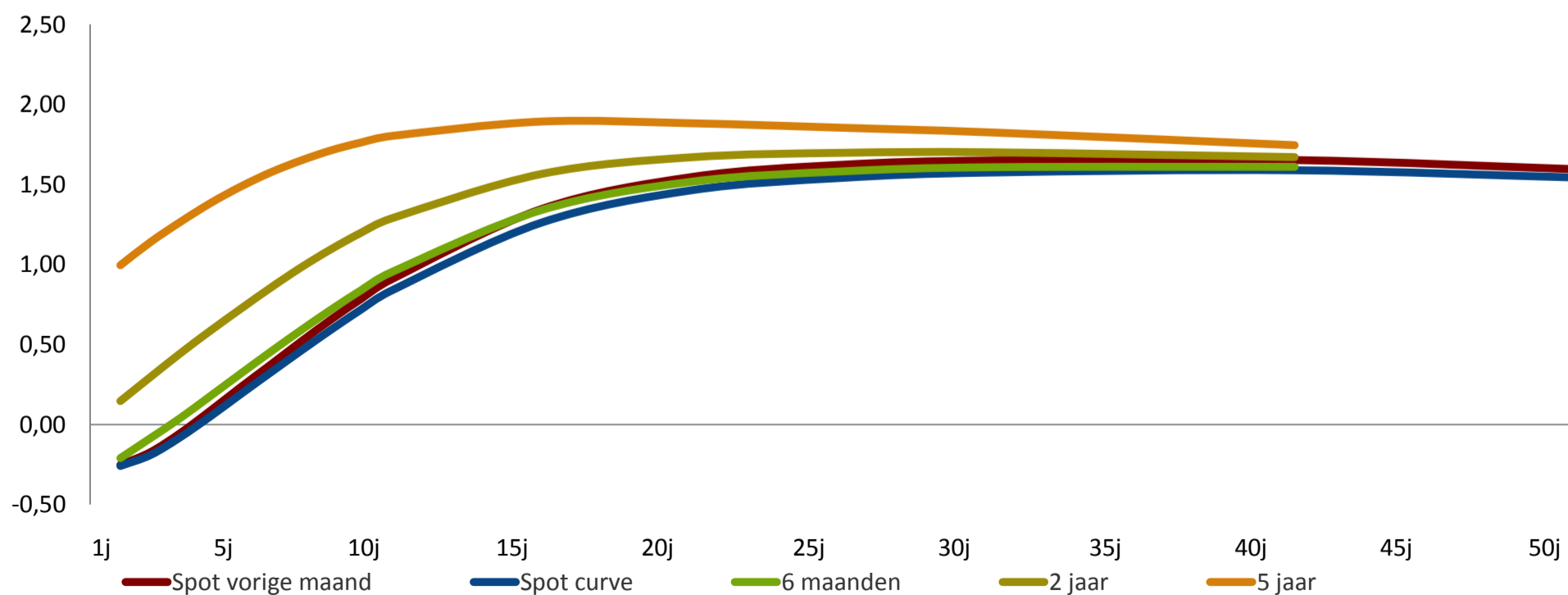


IRS - spot and forwards

| termijn | spot | 3 mnd | 6 mnd | 1 jaar | 2 jaar | 3 jaar | 4 jaar | 5 jaar | spot vorige mnd |
|---------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------------|
| 1 jaar | -0,26 | -0,20 | -0,21 | -0,12 | 0,15 | 0,44 | 0,73 | 0,99 | -0,25 |
| 2 jaar | -0,19 | -0,12 | -0,09 | 0,02 | 0,30 | 0,59 | 0,88 | 1,14 | -0,17 |
| 3 jaar | -0,08 | 0,00 | 0,04 | 0,16 | 0,45 | 0,73 | 1,01 | 1,27 | -0,05 |
| 4 jaar | 0,05 | 0,13 | 0,18 | 0,31 | 0,59 | 0,87 | 1,14 | 1,38 | 0,09 |
| 5 jaar | 0,19 | 0,26 | 0,32 | 0,45 | 0,72 | 1,00 | 1,26 | 1,49 | 0,23 |
| 6 jaar | 0,33 | 0,40 | 0,46 | 0,58 | 0,86 | 1,12 | 1,36 | 1,58 | 0,37 |
| 7 jaar | 0,46 | 0,53 | 0,59 | 0,72 | 0,98 | 1,23 | 1,46 | 1,65 | 0,52 |
| 8 jaar | 0,59 | 0,66 | 0,72 | 0,84 | 1,10 | 1,33 | 1,54 | 1,71 | 0,66 |
| 9 jaar | 0,72 | 0,79 | 0,84 | 0,96 | 1,20 | 1,41 | 1,60 | 1,76 | 0,79 |
| 10 jaar | 0,84 | 0,90 | 0,95 | 1,07 | 1,29 | 1,49 | 1,66 | 1,80 | 0,91 |
| 15 jaar | 1,26 | 1,31 | 1,34 | 1,42 | 1,57 | 1,69 | 1,80 | 1,89 | 1,35 |
| 20 jaar | 1,46 | 1,49 | 1,52 | 1,57 | 1,67 | 1,76 | 1,83 | 1,88 | 1,55 |
| 25 jaar | 1,54 | 1,56 | 1,58 | 1,62 | 1,70 | 1,76 | 1,81 | 1,85 | 1,62 |
| 30 jaar | 1,57 | 1,59 | 1,61 | 1,64 | 1,70 | 1,75 | 1,79 | 1,82 | 1,65 |
| 40 jaar | 1,59 | 1,60 | 1,61 | 1,63 | 1,67 | 1,70 | 1,73 | 1,74 | 1,65 |
| 50 jaar | 1,54 | | | | | | | | 1,59 |

IRS - spot and forward curve

in procenten



Treasury update

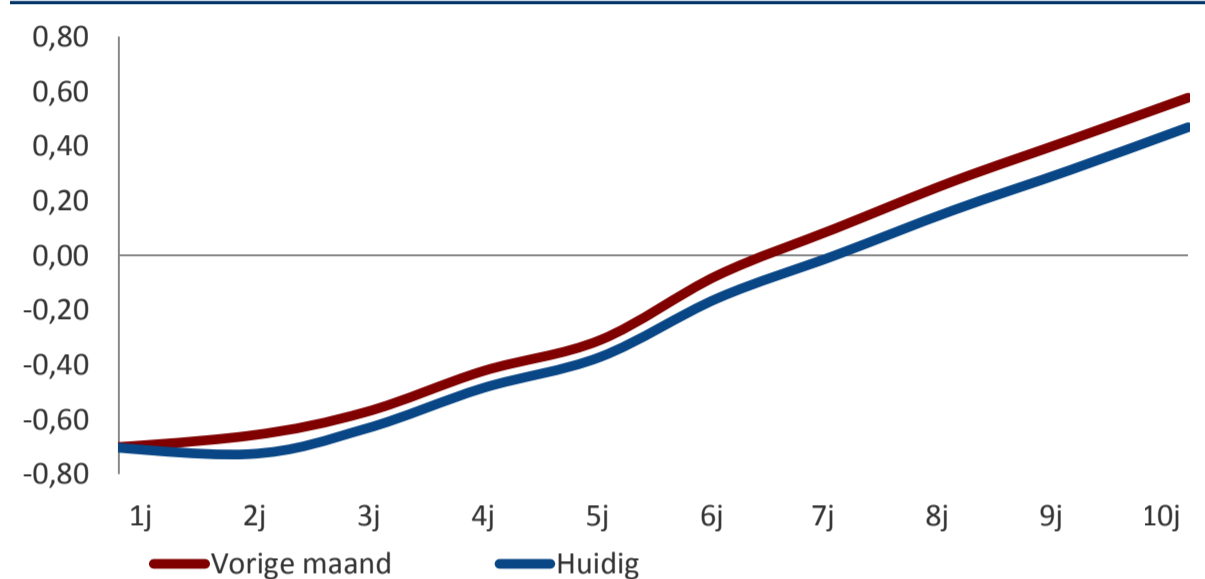
woensdag 18 oktober 2017 9:25

Staatsobligaties NL - rates

| maturity | huidig | vorige mnd |
|-----------|--------|------------|
| 3 maanden | -0,69 | -0,69 |
| 6 maanden | -0,69 | -0,71 |
| 2 jaar | -0,73 | -0,66 |
| 3 jaar | -0,63 | -0,57 |
| 4 jaar | -0,49 | -0,42 |
| 5 jaar | -0,37 | -0,31 |
| 6 jaar | -0,16 | -0,07 |
| 7 jaar | 0,00 | 0,10 |
| 8 jaar | 0,17 | 0,27 |
| 9 jaar | 0,31 | 0,42 |
| 10 jaar | 0,47 | 0,58 |
| 20 jaar | 0,92 | 1,01 |
| 30 jaar | 1,22 | 1,32 |

Staatsobligaties NL - curve

in procenten



Beleidsrente

| land/zone | tarief | vergaderdatum |
|-----------|--------|---------------|
| ECB (NL) | 0,00 | 26 okt 17 |
| BOE (UK) | 0,25 | 02 nov 17 |
| FED (US) | 1,25 | 01 nov 17 |
| BOJ (JPN) | -0,10 | 31 okt 17 |
| RBA (AUS) | 1,50 | 07 nov 17 |

Valutamarkt (euro)

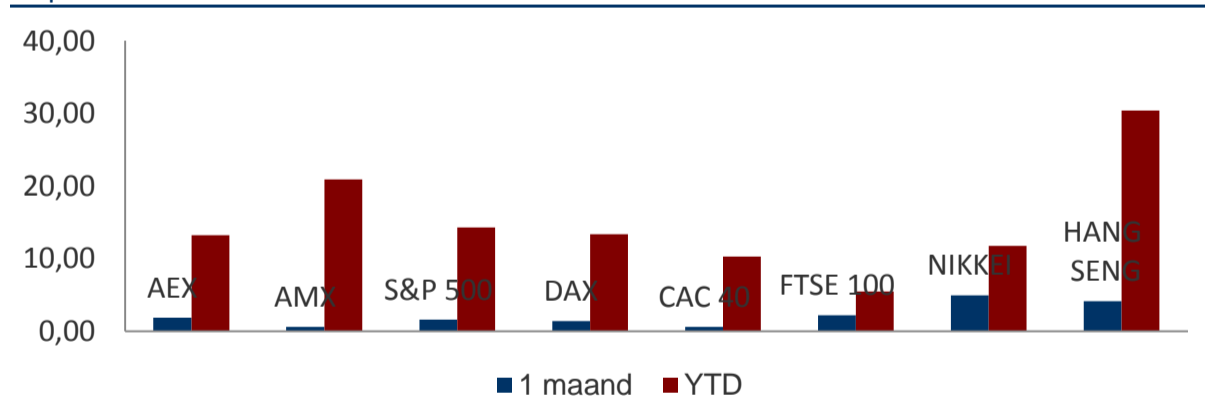
| valuta | huidig | vorige mnd | valuta | huidig | vorige mnd |
|-----------|--------|------------|----------|--------|------------|
| USD (\$) | 1,18 | 1,20 | NOK (kr) | 9,33 | 9,36 |
| GBP (£) | 0,89 | 0,89 | HKD (\$) | 9,19 | 9,34 |
| CHF (CHF) | 1,15 | 1,15 | NZD (\$) | 1,65 | 1,65 |
| JPY (¥) | 132,24 | 133,35 | AUD (\$) | 1,50 | 1,50 |
| SEK (kr) | 9,59 | 9,52 | CAD (\$) | 1,47 | 1,47 |

Aandelenmarkten

| index | waarde | Δ vorige mnd |
|-----------|---------|--------------|
| AEX | 547,1 | 1,86% |
| AMX | 830,8 | 0,58% |
| S&P 500 | 2559,4 | 1,59% |
| DAX | 13010,5 | 1,42% |
| CAC 40 | 5361,0 | 0,59% |
| FTSE 100 | 7534,5 | 2,19% |
| NIKKEI | 21363,1 | 4,95% |
| HANG SENG | 28682,7 | 4,10% |

Aandelenmarkten verschil

in procenten



10-Jaars staatsobligaties buitenland

| land | tarief |
|-----------------------|--------|
| Duitsland (DE) | 0,36 |
| Frankrijk (FR) | 0,77 |
| België (BE) | 0,62 |
| Groot Britannië (GB) | 1,28 |
| Zwitserland (CH) | -0,09 |
| Spanje (ES) | 1,55 |
| Griekenland (GR) | 5,48 |
| Italië (IT) | 2,00 |
| Portugal (PT) | 2,32 |
| Zweden (SE) | 0,85 |
| Verenigde Staten (VS) | 2,31 |
| Japan (JP) | 0,07 |
| China (CN) | 3,75 |

10-Jaars staatsobligaties buitenland

in procenten

