

# Treasury update

maandag 11 december 2017 12:55

## Euribor - rates

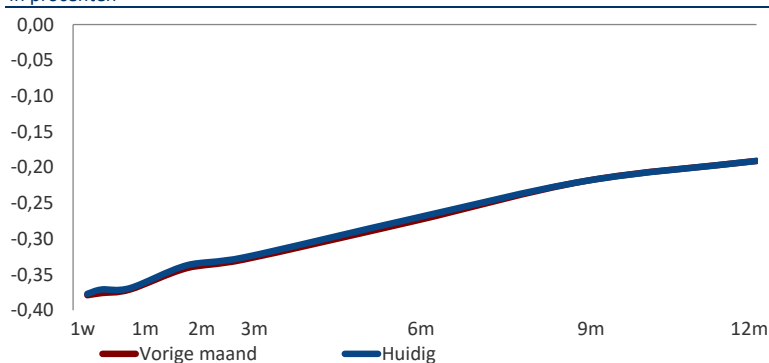
termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,37	-0,38
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,33	-0,33
6 maanden	-0,27	-0,28
9 maanden	-0,22	-0,22
12 maanden	-0,19	-0,19

## EONIA - rates

termijn	huidig	vorige mnd
1 dag	-0,33	-0,36

## Euribor - curve

in procenten

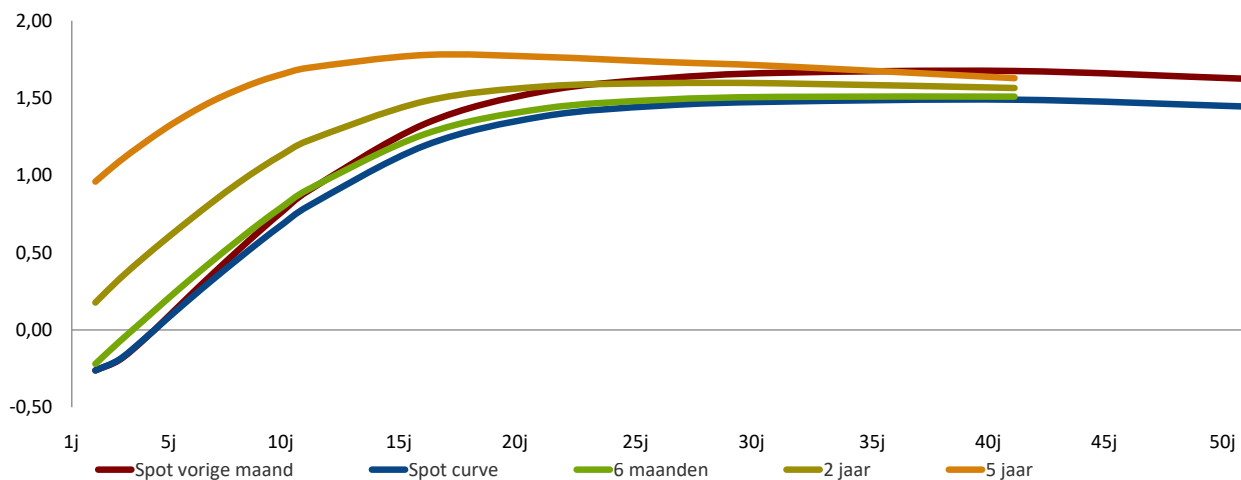


## IRS - spot and forwards

termijn	spot	3 mnd	6 mnd	1 jaar	2 jaar	3 jaar	4 jaar	5 jaar	spot vorige mnd
1 jaar	-0,26	-0,25	-0,22	-0,12	0,18	0,47	0,72	0,96	-0,26
2 jaar	-0,19	-0,14	-0,08	0,03	0,33	0,60	0,85	1,09	-0,20
3 jaar	-0,07	-0,01	0,06	0,18	0,46	0,73	0,97	1,20	-0,07
4 jaar	0,07	0,13	0,19	0,32	0,59	0,85	1,08	1,31	0,07
5 jaar	0,20	0,26	0,32	0,45	0,71	0,96	1,19	1,40	0,22
6 jaar	0,33	0,39	0,45	0,57	0,83	1,07	1,29	1,48	0,37
7 jaar	0,45	0,51	0,57	0,69	0,94	1,17	1,37	1,55	0,51
8 jaar	0,57	0,63	0,69	0,81	1,05	1,26	1,45	1,61	0,64
9 jaar	0,69	0,75	0,80	0,92	1,14	1,34	1,51	1,66	0,78
10 jaar	0,80	0,85	0,91	1,01	1,22	1,41	1,56	1,69	0,90
15 jaar	1,19	1,23	1,27	1,34	1,48	1,60	1,70	1,78	1,33
20 jaar	1,38	1,41	1,43	1,48	1,57	1,65	1,72	1,77	1,54
25 jaar	1,45	1,47	1,49	1,53	1,60	1,65	1,70	1,73	1,63
30 jaar	1,48	1,49	1,51	1,54	1,59	1,64	1,68	1,71	1,66
40 jaar	1,49	1,50	1,51	1,53	1,56	1,59	1,61	1,63	1,67
50 jaar	1,44								1,62

## IRS - spot and forward curve

in procenten



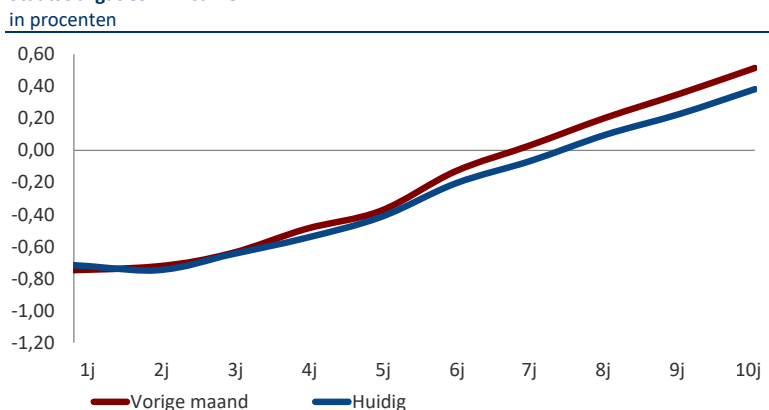
# Treasury update

maandag 11 december 2017 12:55

## Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-1,03	-0,73
6 maanden	-0,73	-0,75
2 jaar	-0,75	-0,72
3 jaar	-0,65	-0,64
4 jaar	-0,55	-0,49
5 jaar	-0,42	-0,38
6 jaar	-0,21	-0,13
7 jaar	-0,07	0,03
8 jaar	0,10	0,20
9 jaar	0,23	0,35
10 jaar	0,38	0,51
20 jaar	0,83	0,99
30 jaar	1,12	1,31

## Staatsobligaties NL - curve



## Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	14 dec 17
BOE (UK)	0,50	14 dec 17
FED (US)	1,25	13 dec 17
BOJ (JPN)	-0,10	21 dec 17
RBA (AUS)	1,50	06 feb 18

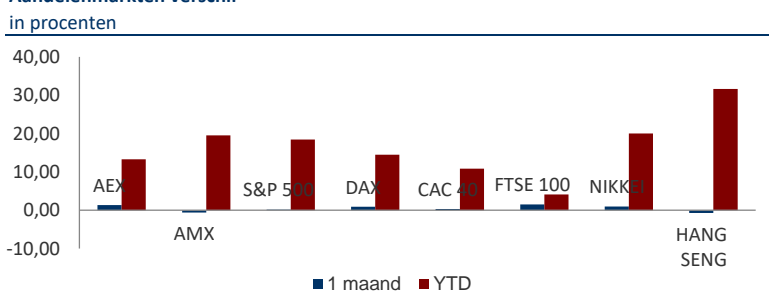
## Valutamarkt (euro)

valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,18	1,17	NOK (kr)	9,88	9,49
GBP (£)	0,88	0,88	HKD (\$)	9,21	9,10
CHF (CHF)	1,17	1,16	NZD (\$)	1,70	1,68
JPY (¥)	133,69	132,39	AUD (\$)	1,57	1,52
SEK (kr)	10,01	9,74	CAD (\$)	1,52	1,48

## Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	547,3	1,33%
AMX	821,4	-0,60%
S&P 500	2651,5	0,15%
DAX	13141,1	0,90%
CAC 40	5389,4	0,31%
FTSE 100	7434,9	1,48%
NIKKEI	22938,7	0,94%
HANG SENG	28965,3	-0,73%

## Aandelenmarkten verschil



## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,29
Frankrijk (FR)	0,62
België (BE)	0,49
Groot-Britannië (GB)	1,22
Zwitserland (CH)	-0,18
Spanje (ES)	1,40
Griekenland (GR)	4,51
Italië (IT)	1,65
Portugal (PT)	1,77
Zweden (SE)	0,67
Verenigde Staten (VS)	2,37
Japan (JP)	0,05
China (CN)	3,95

## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

