

# Treasury update

vrijdag 22 juni 2018 12:55

## Euribor - rates

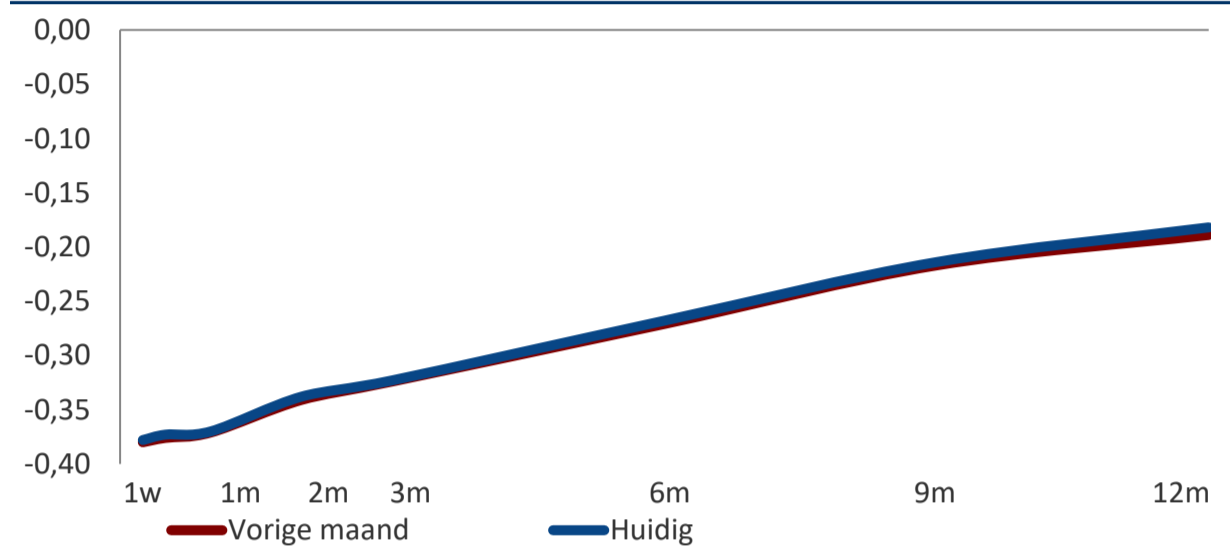
termijn	huidig	vorige mnd
1 week	-0,38	-0,38
2 weken	-0,37	-0,38
1 maand	-0,37	-0,37
2 maanden	-0,34	-0,34
3 maanden	-0,32	-0,32
6 maanden	-0,27	-0,27
9 maanden	-0,21	-0,22
12 maanden	-0,18	-0,19

## EONIA - rates

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

## Euribor - curve

in procenten

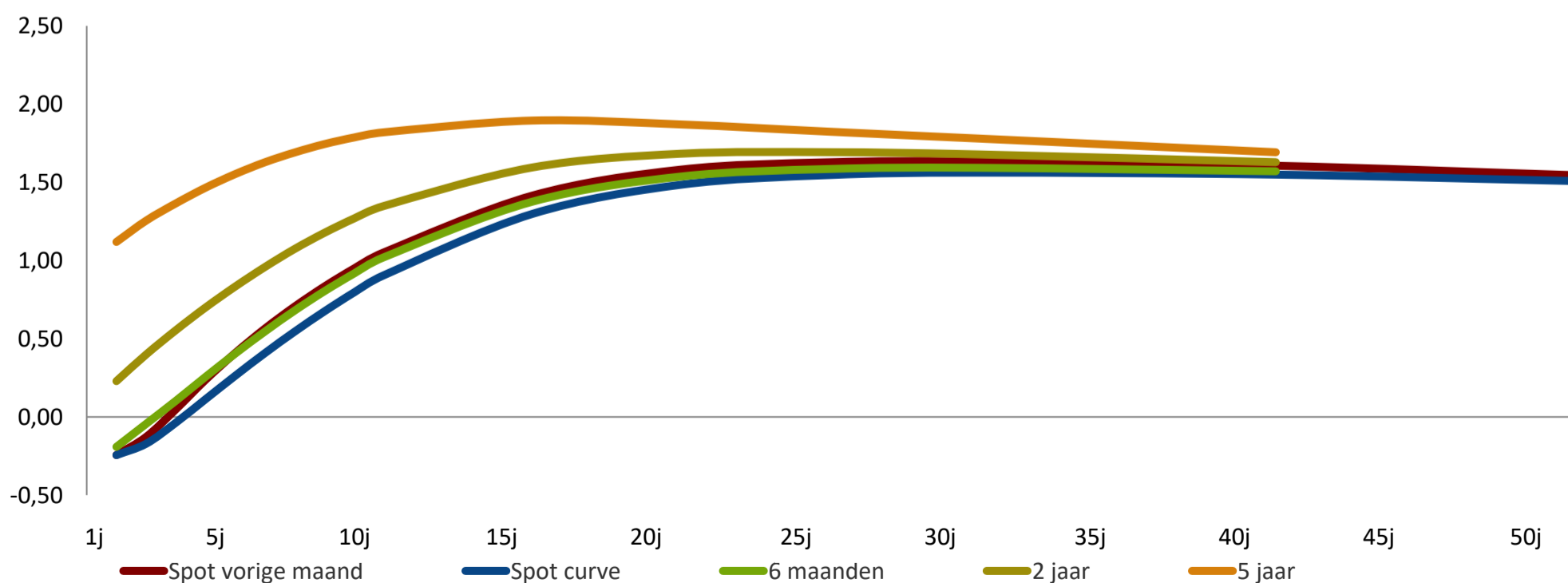


## IRS - spot and forwards

termijn	spot	3 mnd	6 mnd	1 jaar	2 jaar	3 jaar	4 jaar	5 jaar	spot vorige mnd
1 jaar	-0,24	-0,22	-0,19	-0,09	0,23	0,56	0,86	1,12	-0,24
2 jaar	-0,17	-0,10	-0,04	0,07	0,40	0,72	1,00	1,26	-0,13
3 jaar	-0,04	0,03	0,10	0,23	0,55	0,86	1,13	1,37	0,05
4 jaar	0,11	0,19	0,26	0,39	0,70	0,99	1,24	1,47	0,24
5 jaar	0,26	0,34	0,41	0,54	0,83	1,11	1,35	1,55	0,41
6 jaar	0,41	0,48	0,55	0,68	0,96	1,22	1,44	1,63	0,57
7 jaar	0,55	0,61	0,68	0,81	1,07	1,31	1,52	1,69	0,71
8 jaar	0,68	0,74	0,80	0,93	1,18	1,40	1,59	1,74	0,83
9 jaar	0,80	0,86	0,92	1,04	1,27	1,47	1,65	1,79	0,95
10 jaar	0,91	0,96	1,02	1,13	1,35	1,54	1,69	1,82	1,05
15 jaar	1,30	1,34	1,38	1,45	1,60	1,72	1,82	1,89	1,42
20 jaar	1,48	1,51	1,54	1,59	1,68	1,76	1,82	1,87	1,58
25 jaar	1,55	1,57	1,59	1,62	1,69	1,75	1,79	1,82	1,63
30 jaar	1,56	1,58	1,59	1,62	1,68	1,72	1,76	1,78	1,63
40 jaar	1,55	1,56	1,57	1,59	1,63	1,66	1,68	1,69	1,61
50 jaar	1,51								1,55

## IRS - spot and forward curve

in procenten



# Treasury update

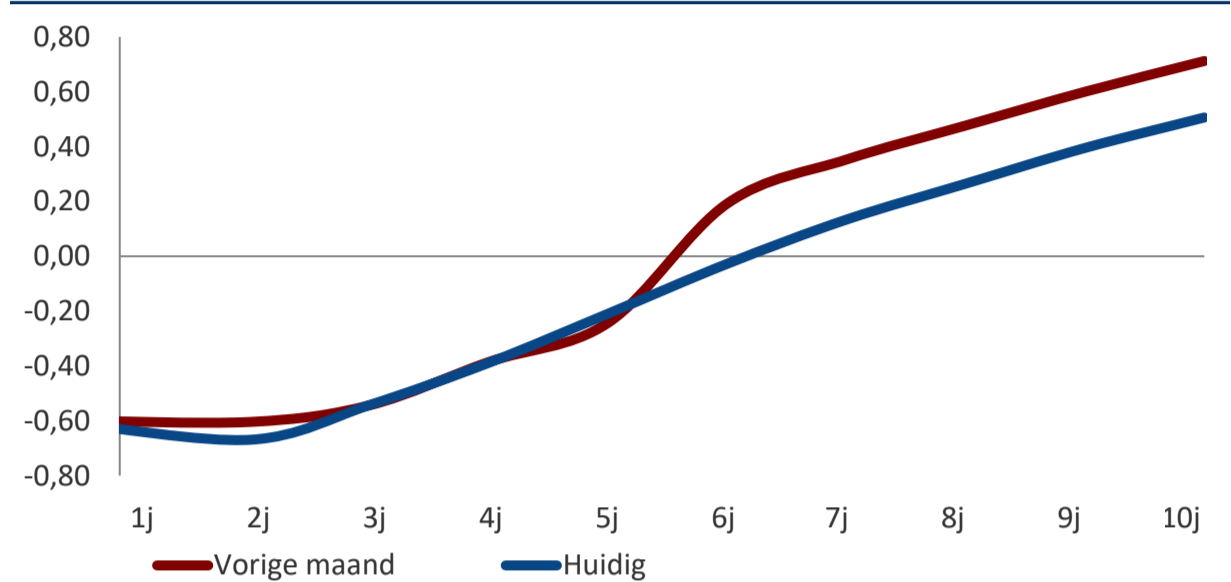
vrijdag 22 juni 2018 12:55

## Staatsobligaties NL - rates

maturity	huidig	vorige mnd
3 maanden	-0,62	-0,61
6 maanden	-0,61	-0,60
2 jaar	-0,67	-0,60
3 jaar	-0,54	-0,54
4 jaar	-0,39	-0,39
5 jaar	-0,21	-0,24
6 jaar	-0,03	0,19
7 jaar	0,13	0,35
8 jaar	0,27	0,48
9 jaar	0,40	0,60
10 jaar	0,51	0,71
20 jaar	0,89	1,03
30 jaar	1,13	1,25

## Staatsobligaties NL - curve

in procenten



## Beleidsrente

land/zone	tarief	vergaderdatum
ECB (NL)	0,00	26 jul 18
BOE (UK)	0,50	02 aug 18
FED (US)	2,00	01 aug 18
BOJ (JPN)	-0,10	31 jul 18
RBA (AUS)	1,50	03 jul 18

## Valutamarkt (euro)

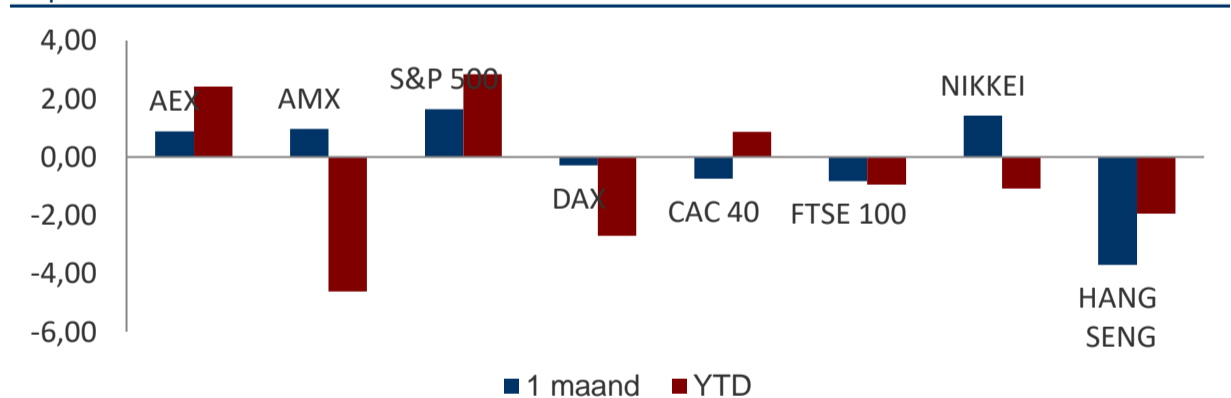
valuta	huidig	vorige mnd	valuta	huidig	vorige mnd
USD (\$)	1,16	1,18	NOK (kr)	9,44	9,49
GBP (£)	0,88	0,88	HKD (\$)	9,13	9,25
CHF (CHF)	1,15	1,17	NZD (\$)	1,69	1,70
JPY (¥)	128,21	130,62	AUD (\$)	1,57	1,55
SEK (kr)	10,30	10,23	CAD (\$)	1,55	1,51

## Aandelenmarkten

index	waarde	Δ vorige mnd
AEX	557,8	0,89%
AMX	796,3	0,97%
S&P 500	2749,8	1,64%
DAX	12568,2	-0,29%
CAC 40	5358,5	-0,74%
FTSE 100	7615,2	-0,82%
NIKKEI	22516,8	1,42%
HANG SENG	29338,7	-3,71%

## Aandelenmarkten verschil

in procenten



## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

land	tarief
Duitsland (DE)	0,35
Frankrijk (FR)	0,71
België (BE)	0,73
Groot-Britannië (GB)	1,32
Zwitserland (CH)	-0,03
Spanje (ES)	1,33
Griekenland (GR)	4,15
Italië (IT)	2,65
Portugal (PT)	1,81
Zweden (SE)	0,51
Verenigde Staten (VS)	2,91
Japan (JP)	0,04
China (CN)	3,59

## 10-Jaars staatsobligaties buitenland

in procenten

