



**Geldmarkt**

**Deposits**

	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	-0.64	-0.45	0.05	0.24	0.01	0.17	-0.13	0.01	-0.84	-0.65
1w	-0.64	-0.45	0.06	0.13	0.01	0.17	-0.18	-0.06	-0.79	-0.60
2w	-0.65	-0.43	0.06	0.13	0.01	0.18	-0.15	-0.03	-0.79	-0.60
1m	-0.65	-0.45	0.08	0.14	-0.02	0.18	-0.14	-0.02	-0.97	-0.72
2m	-0.59	-0.40	0.09	0.15	-0.02	0.18	-0.19	-0.04	-0.86	-0.66
3m	-0.61	-0.40	0.10	0.16	0.05	0.24	-0.14	-0.02	-0.86	-0.66
4m	-0.61	-0.40	0.10	0.16	0.05	0.24	-0.14	-0.02	-0.86	-0.66
5m	-0.61	-0.40	0.10	0.16	0.05	0.24	-0.14	-0.02	-0.86	-0.66
6m	-0.62	-0.40	0.12	0.18	0.05	0.25	-0.21	-0.06	-0.83	-0.63
7m	-0.62	-0.40	0.12	0.18	0.05	0.25	-0.21	-0.06	-0.83	-0.63
8m	-0.62	-0.40	0.12	0.18	0.05	0.25	-0.21	-0.06	-0.83	-0.63
9m	-0.59	-0.40	0.15	0.23	0.15	0.35	-0.16	0.14	-0.84	-0.64
10m	-0.59	-0.40	0.15	0.23	0.15	0.35	-0.16	0.14	-0.84	-0.64
11m	-0.59	-0.40	0.15	0.23	0.15	0.35	-0.16	0.14	-0.84	-0.64
12m	-0.55	-0.35	0.17	0.26	0.20	0.40	-0.19	-0.04	-0.76	-0.56

**Kapitaalmarkt**

**Interest Rate Swaps**

	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	-0.502	-0.494	0.087	0.107	0.110	0.115	-0.190	-0.040	-0.750	-0.730
2y	-0.480	-0.450	0.186	0.236	0.251	0.256	-0.001	-0.001	-0.720	-0.700
3y	-0.442	-0.402	0.366	0.416	0.354	0.359	-0.013	-0.013	-0.680	-0.620
4y	-0.387	-0.357	0.521	0.571	0.418	0.423	-0.025	-0.025	-0.608	-0.548
5y	-0.328	-0.318	0.648	0.698	0.464	0.469	-0.025	-0.025	-0.530	-0.470
6y	-0.270	-0.260	0.758	0.808	0.501	0.506	-0.020	-0.020	-0.450	-0.390
7y	-0.210	-0.200	0.849	0.899	0.533	0.538	-0.011	-0.011	-0.375	-0.315
8y	-0.146	-0.136	0.929	0.979	0.563	0.568	0.004	0.004	-0.308	-0.248
9y	-0.084	-0.074	0.992	1.042	0.591	0.596	0.021	0.021	-0.243	-0.183
10y	-0.038	0.002	1.046	1.096	0.613	0.618	0.041	0.041	-0.185	-0.125
12y	0.075	0.115	1.142	1.192	0.657	0.662	0.080	0.080	-0.080	-0.020
15y	0.208	0.248	1.239	1.289	0.701	0.706	0.149	0.149	0.020	0.080
20y	0.314	0.354	1.331	1.381	0.723	0.728	0.256	0.256	0.095	0.155
25y	0.330	0.370	1.365	1.415	0.718	0.723	0.348	0.348	0.095	0.155
30y	0.305	0.345	1.379	1.429	0.700	0.705	0.415	0.415	0.055	0.115

\* Houd er rekening mee dat alle tarieven slechts ter indicatie zijn.

**Valuta markt**

**Spot Rates**

	BID	ASK
EUR Majors	1,1796	1,1799
EURUSD	0,8580	0,8584
EURGBP	129,79	129,84
EURJPY	1,0857	1,0862
EURCHF	1,4935	1,4936

**USD Majors**

	BID	ASK
GBPUSD	1,3745	1,3749
USDJPY	110,02	110,03
USDCHF	0,9204	0,9207
USDCAD	1,2655	1,2659
NZDUSD	0,6989	0,6993
AUDUSD	0,7378	0,7380

**Scandies**

	BID	ASK
EURNOK	10,4661	10,4706
EURDKK	7,4377	7,4379
EURSEK	10,2541	10,2586

**Eastern EU**

	BID	ASK
EURPLN	359,50	359,81
EURCZK	25,526	25,567
EURTRY	10,0944	10,1084
EURRUB	87,624	87,649

**Asia Pacific**

	BID	ASK
NZDUSD	0,5926	0,5928
EURAUD	1,5986	1,5989
EURSGD	1,6031	1,6036
EURHKD	9,1628	9,1667
EURCNY	7,6471	7,6495

**Crypto currency**

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	31801,74	9,71

**Forwards**

	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	0,21	0,24	0,01	0,04	-0,19	0,04	-0,24	-0,22
1w	1,51	1,66	0,15	0,30	-0,53	-0,49	-1,69	-1,58
2w	3,14	3,34	0,41	0,60	-1,17	-1,10	-3,38	-3,23
1m	7,45	7,75	0,89	1,21	-2,69	-2,65	-7,91	-7,59
2m	14,13	14,53	1,52	2,10	-5,25	-5,11	-14,65	-14,47
3m	21,61	21,99	2,60	3,20	-8,50	-8,20	-22,13	-21,60
6m	47,03	48,23	7,24	8,96	-22,56	-21,78	-47,15	-46,65
9m	68,16	69,66	5,20	8,20	-33,00	-32,30	-69,25	-68,00
12m	90,43	92,23	3,36	3,36	-45,16	-45,16	-93,00	-89,95

**Volatilities ATM**

	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1w	5,31	5,81	6,41	7,11	4,70	5,30	5,43	6,18
1m	5,33	5,43	6,71	7,01	5,25	5,50	5,88	6,18
2m	5,38	5,53	6,61	6,91	5,40	5,65	5,90	6,15
3m	5,37	5,52	6,63	6,88	5,54	5,74	5,89	6,14
6m	5,49	5,59	6,78	6,98	5,74	5,99	6,03	6,23
9m	5,75	5,85	6,90	7,15	5,96	6,16	6,06	6,26
12m	5,92	6,07	7,03	7,28	6,15	6,30	6,14	6,39

**Euribor fixings**

Date	Rate
16/07	16,07
1w	-0,562
1m	-0,557
3m	-0,548
6m	-0,515
12m	-0,488

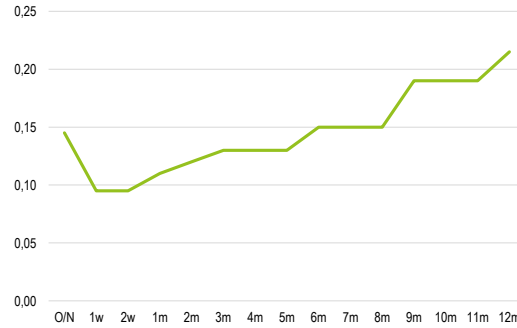
**FRAs**

	EUR	EUR	USD	USD
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	-0,560	-0,520	0,103	0,143
2x5	-0,560	-0,520	0,108	0,148
3x6	-0,540	-0,520	0,127	0,167
6x9	-0,530	-0,510	0,158	0,198
6x12	-0,500	-0,460	0,190	0,240
12x18	-0,447	-0,437	0,340	0,360
18x24	-0,405	-0,437	0,560	0,600

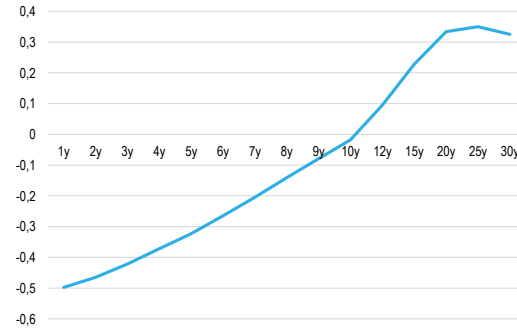
EUR Geldmarkt



USD Geldmarkt



EUR Kapitaalmarkt



USD Kapitaalmarkt

