

Finance & Treasury support: Tel. +31(0)35-5266292, info@treasurylinq.com

Date Time CET

Interest rate markets

Deposits										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	3,64	3,84	5,23	5,43	5,15	5,29	-0,40	0,10	0,91	1,06
1w	3,61	3,91	5,26	5,56	5,11	5,29	-0,13	0,15	1,05	1,33
2w	3,63	3,84	5,28	5,48	5,13	5,29	-0,11	0,17	1,13	1,33
1m	3,65	3,95	5,29	5,49	5,11	5,29	-0,14	0,06	1,02	1,27
2m	3,66	3,96	5,31	5,51	5,10	5,29	-0,11	0,09	1,01	1,26
3m	3,67	3,97	5,30	5,50	5,08	5,38	0,30	0,37	1,01	1,26
4m	3,67	3,97	5,30	5,50	5,08	5,38	0,30	0,37	1,01	1,26
5m	3,67	3,97	5,30	5,50	5,08	5,38	0,30	0,37	1,01	1,26
6m	3,60	3,90	5,26	5,46	5,10	5,29	-0,01	0,24	1,02	1,27
7m	3,60	3,90	5,26	5,46	5,10	5,29	-0,01	0,24	1,02	1,27
8m	3,60	3,90	5,26	5,46	5,10	5,29	-0,01	0,24	1,02	1,27
9m	3,57	3,87	5,15	5,35	5,17	5,29	0,10	0,35	1,02	1,27
10m	3,57	3,87	5,15	5,35	5,17	5,29	0,10	0,35	1,02	1,27
11m	3,57	3,87	5,15	5,35	5,17	5,29	0,10	0,35	1,02	1,27
12m	3,51	3,81	5,06	5,26	5,05	5,24	-0,10	0,15	1,08	1,28

Interest Rate Swaps										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	3,439	3,443	4,767	4,817	4,813	4,818	-0,100	0,150	0,913	0,993
2y	3,048	3,058	4,253	4,303	4,396	4,406	0,513	0,513	0,870	0,890
3y	2,866	2,876	4,010	4,060	4,155	4,160	0,611	0,611	0,778	0,938
4y	2,777	2,787	3,871	3,921	4,002	4,007	0,685	0,685	0,775	0,935
5y	2,729	2,739	3,792	3,842	3,901	3,906	0,750	0,750	0,780	0,940
6y	2,702	2,712	3,744	3,794	3,840	3,845	0,821	0,821	0,795	0,955
7y	2,692	2,702	3,710	3,760	3,811	3,816	0,890	0,890	0,815	0,975
8y	2,681	2,711	3,688	3,738	3,801	3,806	0,960	0,960	0,889	0,939
9y	2,696	2,706	3,676	3,726	3,805	3,810	1,026	1,026	0,858	1,018
10y	2,692	2,732	3,675	3,725	3,819	3,824	1,093	1,093	0,878	1,038
12y	2,717	2,757	3,695	3,745	3,859	3,864	1,224	1,224	0,910	1,070
15y	2,736	2,776	3,720	3,770	3,911	3,916	1,384	1,384	0,940	1,100
20y	2,676	2,716	3,702	3,752	3,948	3,953	1,599	1,599	0,940	1,100
25y	2,572	2,612	3,632	3,682	3,946	3,951	1,716	1,716	0,915	1,075
30y	2,470	2,510	3,553	3,603	3,919	3,924	1,779	1,779	0,875	1,035

Foreign exchange markets

Spot Rates		
EUR Majors		
EURUSD	BID	ASK
	1,0879	1,0883
EURGBP	0,8421	0,8425
EURJPY	170,22	170,23
EURCHF	0,9659	0,9662
EURCAD	1,4949	1,4950
USD Majors		
GBPUSD	1,2915	1,2920
USDJPY	156,44	156,45
USDCHF	0,8876	0,8880
USDCAD	1,3738	1,3742
NZDUSD	0,5997	0,6000
AUDUSD	0,6663	0,6667
Scandies		
EURNOK	11,8754	11,8828
EURDKK	7,4613	7,4616
EURSEK	11,6217	11,6228
Eastern EU		
EURPLN	4,2828	4,2838
EURHUF	390,54	390,86
EURCZK	25,202	25,222
EURTRY	35,9251	35,9281
EURRUB	95,013	95,022
Asia Pacific		
NZDEUR	0,5513	0,5514
EURAUD	1,6324	1,6327
EURSGD	1,4630	1,4631
EURHKD	8,4952	8,4958
EURCNY	7,9093	7,9185

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	67419,3	60,81

Forwards								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	0,45	0,55	0,33	0,35	-2,31	-1,33	-0,74	-0,66
1w	3,50	3,54	2,35	2,45	-12,55	-12,29	-4,87	-4,78
2w	7,07	7,24	4,63	4,85	-24,88	-24,52	-9,80	-9,75
1m	16,66	16,73	11,07	11,10	-58,63	-57,84	-23,21	-22,78
2m	31,48	31,67	20,25	20,66	-109,35	-108,24	-42,75	-42,59
3m	46,21	47,21	31,04	31,30	-159,71	-158,25	-63,46	-62,95
6m	92,36	96,36	64,90	65,62	-308,04	-301,56	-124,70	-122,38
9m	135,15	136,81	96,97	97,96	-431,52	-426,00	-179,67	-176,16
12m	175,40	177,60	130,04	131,45	-544,75	-535,46	-227,35	-226,12

Volatilities ATM								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1w	4,34	4,99	3,30	4,30	7,28	8,78	5,05	6,05
1m	5,25	5,35	3,98	4,33	8,40	8,90	4,85	5,25
2m	5,44	5,54	4,13	4,53	8,20	8,70	4,85	5,25
3m	5,46	5,56	4,21	4,61	8,35	8,70	4,96	5,31
6m	5,83	5,98	4,59	4,94	8,64	9,14	5,16	5,46
9m	6,02	6,17	4,84	5,14	8,70	9,20	5,26	5,66
12m	6,23	6,38	5,10	5,45	8,85	9,35	5,40	5,85

Euribor fixings	
Date	19/07/2024
1w	3,622
1m	3,626
3m	3,698
6m	3,633
12m	3,502

FRAs	EUR	EUR	USD	USD
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	3,566	3,616	5,437	5,457
2x5	3,470	3,520	5,317	5,337
3x6	3,388	3,438	5,193	5,213
6x9	3,127	3,177	4,799	4,819
6x12	3,091	3,111	4,817	4,837
12x18	2,700	2,720	4,299	4,319
18x24	2,485	2,535		

* Please note that all rates are for indication only