

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	3,15	3,35	4,75	4,98	4,90	5,09	0,00	0,23	0,75	1,05
1w	3,10	3,35	4,78	5,04	4,91	5,09	-0,11	0,14	0,72	0,97
2w	3,10	3,35	4,76	4,82	4,95	5,09	-0,08	0,17	0,77	1,12
1m	3,09	3,32	4,57	4,82	4,74	4,93	-0,08	0,12	0,70	0,95
2m	3,05	3,40	4,78	4,88	4,71	4,91	-0,04	0,16	0,62	0,87
3m	3,02	3,37	4,61	4,86	4,80	4,99	-0,18	0,02	0,56	0,81
4m	3,02	3,37	4,61	4,86	4,80	4,99	-0,18	0,02	0,56	0,81
5m	3,02	3,37	4,61	4,86	4,80	4,99	-0,18	0,02	0,56	0,81
6m	2,83	2,96	4,67	4,77	4,76	4,93	0,04	0,29	0,75	0,95
7m	2,83	2,96	4,67	4,77	4,76	4,93	0,04	0,29	0,75	0,95
8m	2,83	2,96	4,67	4,77	4,76	4,93	0,04	0,29	0,75	0,95
9m	2,74	2,84	4,60	4,72	4,57	4,75	0,20	0,45	0,54	0,79
10m	2,74	2,84	4,60	4,72	4,57	4,75	0,20	0,45	0,54	0,79
11m	2,74	2,84	4,60	4,72	4,57	4,75	0,20	0,45	0,54	0,79
12m	2,55	2,75	4,54	4,66	4,63	4,76	0,20	0,40	0,65	0,85

Interest Rate Swaps										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	2,515	2,521	4,134	4,154	4,259	4,264	0,200	0,400	0,420	0,440
2y	2,299	2,309	3,851	3,871	4,014	4,044	0,603	0,603	0,330	0,350
3y	2,269	2,279	3,714	3,764	3,951	3,956	0,666	0,666	0,273	0,433
4y	2,276	2,296	3,663	3,713	3,900	3,905	0,718	0,718	0,308	0,468
5y	2,303	2,307	3,633	3,683	3,869	3,874	0,769	0,769	0,345	0,505
6y	2,328	2,332	3,627	3,677	3,851	3,856	0,821	0,821	0,383	0,543
7y	2,354	2,358	3,631	3,681	3,847	3,852	0,880	0,880	0,415	0,575
8y	2,383	2,387	3,640	3,690	3,853	3,858	0,938	0,938	0,503	0,553
9y	2,409	2,413	3,652	3,702	3,867	3,872	1,000	1,000	0,475	0,635
10y	2,433	2,437	3,666	3,716	3,887	3,892	1,065	1,065	0,503	0,663
12y	2,459	2,499	3,695	3,745	3,934	3,939	1,200	1,200	0,553	0,713
15y	2,498	2,538	3,729	3,779	3,993	3,998	1,376	1,376	0,600	0,760
20y	2,457	2,497	3,729	3,779	4,039	4,044	1,625	1,625	0,608	0,768
25y	2,366	2,406	3,663	3,713	4,038	4,043	1,773	1,773	0,585	0,745
30y	2,273	2,313	3,580	3,630	4,009	4,014	1,860	1,860	0,543	0,703

Foreign exchange markets

Spot Rates		
<u>EUR Majors</u>		
EURUSD	BID	ASK
	1,0813	1,0815
EURGBP	0,8338	0,8339
EURJPY	165,82	165,83
EURCHF	0,9377	0,9382
EURCAD	1,5019	1,5020
<u>USD Majors</u>		
GBPUSD	1,2970	1,2971
USDJPY	153,33	153,34
USDCHF	0,8673	0,8674
USDCAD	1,3888	1,3889
NZDUSD	0,5972	0,5975
AUDUSD	0,6597	0,6602
<u>Scandies</u>		
EURNOK	11,9059	11,9082
EURDKK	7,4616	7,4618
EURSEK	11,4630	11,4641
<u>Eastern EU</u>		
EURPLN	4,3502	4,3514
EURHUF	404,55	404,83
EURCZK	25,315	25,325
EURTRY	37,0806	37,0909
EURRUB	104,954	104,963
<u>Asia Pacific</u>		
NZDEUR	0,5523	0,5524
EURAUD	1,6382	1,6384
EURSGD	1,4300	1,4309
EURHKD	8,4034	8,4040
EURCNY	7,7033	7,7125

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	68392	63,12

Forwards								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	0,44	0,54	0,39	0,42	-1,89	-0,92	-0,67	-0,56
1w	3,56	3,57	2,86	2,90	-11,25	-11,17	-4,36	-4,33
2w	6,65	6,85	5,34	5,44	-20,99	-20,83	-9,04	-8,92
1m	13,71	13,73	10,95	11,03	-43,82	-43,37	-18,70	-18,50
2m	28,07	28,10	22,36	22,54	-87,23	-86,05	-38,53	-38,27
3m	44,84	45,14	35,52	35,80	-134,16	-133,92	-58,77	-58,15
6m	94,78	95,37	74,86	75,26	-228,30	-225,66	-106,34	-105,58
9m	148,04	149,23	115,87	116,85	-306,24	-302,06	-150,29	-148,09
12m	201,67	203,67	157,69	158,78	-377,12	-370,61	-191,71	-188,49

Volatilities ATM								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1w	6,33	7,13	4,59	5,59	10,89	12,24	4,15	5,15
1m	7,94	8,09	4,96	5,16	11,11	11,61	5,55	5,95
2m	7,30	7,50	4,72	5,07	10,68	11,18	5,58	6,03
3m	6,81	7,01	4,63	4,98	10,48	10,83	5,48	5,88
6m	6,61	6,76	4,76	5,11	10,17	10,67	5,61	5,91
9m	6,55	6,70	4,91	5,21	9,98	10,48	5,62	5,97
12m	6,55	6,75	5,03	5,33	9,91	10,41	5,68	5,98

Euribor fixings	
Date	25/10/2024
1w	3,149
1m	3,127
3m	3,059
6m	2,894
12m	2,565

FRAs	EUR		USD	
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	2,880	2,930	4,714	4,734
2x5	2,673	2,693	4,616	4,636
3x6	2,515	2,525	4,229	4,249
6x9	2,079	2,099	4,193	4,213
6x12	2,067	2,087	4,278	4,298
12x18	1,973	1,993	4,032	4,052
18x24	2,039	2,059		

* Please note that all rates are for indication only