

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	2,87	3,07	4,25	4,49	4,60	4,80	0,00	0,30	0,20	0,50
1w	2,60	2,90	4,26	4,50	4,37	4,57	0,11	0,36	0,22	0,57
2w	2,71	2,79	4,35	4,41	4,45	4,65	0,14	0,39	0,22	0,57
1m	2,66	2,96	4,23	4,48	4,46	4,66	0,35	0,55	0,21	0,46
2m	2,62	2,92	4,43	4,53	4,49	4,69	0,18	0,38	0,16	0,41
3m	2,60	2,90	4,45	4,55	4,56	4,76	0,23	0,43	0,14	0,39
4m	2,60	2,90	4,45	4,55	4,56	4,76	0,23	0,43	0,14	0,39
5m	2,60	2,90	4,45	4,55	4,56	4,76	0,23	0,43	0,14	0,39
6m	2,45	2,75	4,48	4,58	4,53	4,73	0,32	0,57	0,14	0,39
7m	2,45	2,75	4,48	4,58	4,53	4,73	0,32	0,57	0,14	0,39
8m	2,45	2,75	4,48	4,58	4,53	4,73	0,32	0,57	0,14	0,39
9m	2,39	2,69	4,51	4,61	4,56	4,76	0,46	0,71	0,18	0,43
10m	2,39	2,69	4,51	4,61	4,56	4,76	0,46	0,71	0,18	0,43
11m	2,39	2,69	4,51	4,61	4,56	4,76	0,46	0,71	0,18	0,43
12m	2,38	2,68	4,53	4,64	4,50	4,73	0,55	0,75	0,19	0,39

Interest Rate Swaps										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	2,326	2,330	4,191	4,231	4,233	4,238	0,550	0,750	0,083	0,113
2y	2,197	2,207	4,072	4,122	4,068	4,073	0,851	0,851	0,050	0,070
3y	2,204	2,214	3,979	4,029	3,975	4,015	0,924	0,924	0,096	0,126
4y	2,228	2,238	3,970	4,020	3,950	3,955	0,969	0,969	0,075	0,235
5y	2,252	2,262	3,968	4,018	3,930	3,935	1,010	1,010	0,190	0,220
6y	2,279	2,285	3,975	4,025	3,925	3,930	1,053	1,053	0,235	0,265
7y	2,301	2,311	3,989	4,039	3,933	3,938	1,100	1,100	0,281	0,311
8y	2,327	2,333	4,002	4,052	3,952	3,957	1,150	1,150	0,317	0,364
9y	2,350	2,360	4,014	4,064	3,977	3,982	1,200	1,200	0,358	0,388
10y	2,374	2,384	4,027	4,077	4,007	4,012	1,256	1,256	0,393	0,423
12y	2,396	2,436	4,046	4,096	4,071	4,076	1,375	1,375	0,454	0,484
15y	2,425	2,465	4,070	4,120	4,150	4,155	1,529	1,529	0,515	0,545
20y	2,376	2,416	4,061	4,111	4,218	4,223	1,751	1,751	0,543	0,573
25y	2,275	2,315	3,986	4,036	4,230	4,235	1,883	1,883	0,528	0,558
30y	2,178	2,218	3,893	3,943	4,205	4,210	1,959	1,959	0,486	0,516

Foreign exchange markets

03-02-25 9:21:23

Spot Rates		
<u>EUR Majors</u>		
EURUSD	BID	ASK
	1,0230	1,0232
EURGBP	0,8312	0,8319
EURJPY	159,21	159,23
EURCHF	0,9396	0,9402
EURCAD	1,5036	1,5039
<u>USD Majors</u>		
GBPUSD	1,2300	1,2307
USDJPY	155,62	155,64
USDCHF	0,9183	0,9190
USDCAD	1,4695	1,4702
NZDUSD	0,5559	0,5563
AUDUSD	0,6143	0,6144
<u>Scandies</u>		
EURNOK	11,6995	11,7041
EURDKK	7,4618	7,4620
EURSEK	11,5027	11,5038
<u>Eastern EU</u>		
EURPLN	4,2216	4,2232
EURHUF	408,83	409,00
EURCZK	25,222	25,233
EURTRY	36,8213	36,8331
EURRUB	102,299	102,308
<u>Asia Pacific</u>		
NZDEUR	0,5434	0,5436
EURAUD	1,6651	1,6653
EURSGD	1,3984	1,3986
EURHKD	7,9735	7,9740
EURCNY	7,6016	7,6092

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	95509,4	1,95

Forwards								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	0,37	0,42	0,38	0,43	-1,33	-1,24	-0,72	-0,68
1w	3,25	3,28	2,84	2,93	-9,58	-9,30	-4,37	-4,32
2w	6,48	6,54	5,58	5,76	-15,45	-15,25	-8,71	-8,65
1m	13,10	13,19	11,25	11,39	-30,90	-30,49	-17,50	-17,34
2m	30,45	30,57	26,12	26,32	-64,08	-63,31	-37,51	-37,04
3m	46,19	46,51	40,08	40,34	-90,92	-90,74	-54,31	-53,64
6m	101,51	102,66	84,86	85,39	-162,79	-160,26	-104,89	-103,53
9m	159,46	161,78	128,70	133,67	-224,04	-220,01	-152,62	-150,01
12m	218,82	223,49	177,44	179,02	-283,16	-275,61	-199,97	-195,84

Volatilities ATM								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1w	10,88	11,63	5,13	6,13	11,63	12,63	5,16	6,16
1m	8,73	8,93	4,84	5,14	10,50	10,80	4,99	5,39
2m	8,41	8,61	4,84	5,24	10,41	10,91	5,12	5,52
3m	8,17	8,32	4,86	5,26	10,38	10,73	5,02	5,42
6m	8,00	8,15	5,03	5,38	10,12	10,62	5,15	5,50
9m	7,93	8,08	5,18	5,53	10,03	10,53	5,26	5,56
12m	7,88	8,03	5,31	5,66	9,95	10,45	5,34	5,64

Euribor fixings	
Date	31/01/2025
1w	2,801
1m	2,660
3m	2,589
6m	2,590
12m	2,519

FRAs	EUR		USD	
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	2,407	2,457	4,529	4,549
2x5	2,280	2,300	4,494	4,514
3x6	2,185	2,235	4,451	4,471
6x9	1,974	2,024	4,263	4,303
6x12	2,008	2,058	4,487	4,507
12x18	1,994	2,014	4,390	4,410
18x24	2,052	2,102		

\* Please note that all rates are for indication only