

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

Interest rate markets

Deposits										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	1,88	2,08	4,22	4,42	3,95	4,15	0,38	0,51	-0,24	0,10
1w	1,87	2,12	4,30	4,42	3,99	4,19	0,20	0,60	-0,22	0,13
2w	1,86	2,11	4,25	4,45	3,96	4,16	0,23	0,43	-0,25	0,10
1m	1,81	2,11	4,28	4,44	3,98	4,18	0,38	0,58	-0,15	0,05
2m	1,81	2,11	4,15	4,40	3,96	4,22	0,43	0,68	-0,08	0,12
3m	2,04	2,34	4,14	4,39	4,05	4,25	0,34	0,54	-0,13	0,08
4m	2,04	2,34	4,14	4,39	4,05	4,25	0,34	0,54	-0,13	0,08
5m	2,04	2,34	4,14	4,39	4,05	4,25	0,34	0,54	-0,13	0,08
6m	1,85	1,95	4,25	4,32	4,12	4,32	0,44	0,64	-0,12	0,08
7m	1,85	1,95	4,25	4,32	4,12	4,32	0,44	0,64	-0,12	0,08
8m	1,85	1,95	4,25	4,32	4,12	4,32	0,44	0,64	-0,12	0,08
9m	2,15	2,23	4,06	4,31	4,15	4,35	0,63	0,93	-0,10	0,10
10m	2,15	2,23	4,06	4,31	4,15	4,35	0,63	0,93	-0,10	0,10
11m	2,15	2,23	4,06	4,31	4,15	4,35	0,63	0,93	-0,10	0,10
12m	1,98	2,09	4,02	4,27	4,14	4,34	0,68	0,88	-0,03	0,17

Interest Rate Swaps										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	2,054	2,081	3,732	3,765	3,852	3,872	0,680	0,880	-0,135	-0,105
2y	2,079	2,107	3,387	3,417	3,720	3,750	0,961	0,961	-0,111	-0,081
3y	2,171	2,200	3,277	3,327	3,728	3,748	1,056	1,056	-0,034	-0,004
4y	2,262	2,288	3,279	3,329	3,767	3,772	1,124	1,124	0,058	0,088
5y	2,346	2,371	3,313	3,363	3,814	3,819	1,185	1,185	0,145	0,175
6y	2,423	2,448	3,378	3,428	3,876	3,881	1,244	1,244	0,221	0,251
7y	2,496	2,522	3,443	3,493	3,945	3,950	1,309	1,309	0,292	0,322
8y	2,565	2,590	3,509	3,559	4,018	4,023	1,374	1,374	0,361	0,391
9y	2,629	2,654	3,575	3,625	4,092	4,097	1,443	1,443	0,427	0,457
10y	2,686	2,712	3,638	3,688	4,164	4,169	1,518	1,518	0,491	0,521
12y	2,778	2,818	3,754	3,804	4,298	4,303	1,676	1,676	0,596	0,626
15y	2,876	2,916	3,884	3,934	4,457	4,462	1,919	1,919	0,697	0,727
20y	2,936	2,976	3,988	4,038	4,609	4,614	2,259	2,259	0,773	0,803
25y	2,930	2,970	3,999	4,049	4,672	4,677	2,471	2,471	0,789	0,819
30y	2,914	2,954	3,967	4,017	4,679	4,684	2,599	2,599	0,777	0,807

Foreign exchange markets

Spot Rates		
EUR Majors		
	BID	ASK
EURUSD	1,1714	1,1715
EURGBP	0,8667	0,8671
EURJPY	172,47	172,48
EURCHF	0,9394	0,9398
EURCAD	1,6199	1,6206
USD Majors		
	BID	ASK
GBPUSD	1,3509	1,3516
USDJPY	147,23	147,24
USDCHE	0,8019	0,8024
USDCAD	1,3830	1,3834
NZDUSD	0,5871	0,5874
AUDUSD	0,6494	0,6497
Scandies		
	BID	ASK
EURNOK	11,8176	11,8246
EURDKK	7,4643	7,4644
EURSEK	11,1476	11,1487
Eastern EU		
	BID	ASK
EURPLN	4,2615	4,2630
EURHUF	396,38	396,68
EURCZK	24,525	24,530
EURTRY	48,0601	48,0732
EURRUB	94,532	94,541
Asia Pacific		
	BID	ASK
NZDEUR	not be found	not be found (Error code: 0)
EURAUD	1,8033	1,8036
EURSGD	1,5008	1,5018
EURHKD	9,1471	9,1524
EURCNY	8,3781	8,3794

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	112006	19,55

Forwards									
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF		
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	
O/N	0,76	0,78	0,34	0,44	-1,96	0,66	-0,57	-0,51	
1w	5,48	5,53	3,47	3,56	-5,52	-5,43	-3,85	-3,79	
2w	10,94	10,99	6,84	6,85	-10,89	-10,57	-7,65	-7,53	
1m	25,07	25,16	15,82	15,97	-25,58	-24,86	-18,13	-18,00	
2m	45,40	45,60	29,38	29,75	-47,87	-46,90	-33,73	-33,42	
3m	67,67	67,97	45,00	45,40	-70,85	-70,03	-51,23	-50,66	
6m	128,05	129,09	90,23	91,07	-135,65	-134,07	-101,16	-99,57	
9m	180,67	181,87	130,60	134,50	-191,67	-185,11	-148,09	-145,69	
12m	228,77	230,57	173,58	175,77	-245,35	-234,07	-196,49	-192,47	

Volatilities ATM									
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF		
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	
1w	6,28	7,03	3,96	4,96	5,79	7,19	3,91	4,91	
1m	7,27	7,52	4,74	5,14	7,39	7,89	4,70	5,10	
2m	7,13	7,33	4,83	5,18	7,57	7,92	4,68	5,08	
3m	7,15	7,35	5,07	5,42	7,90	8,25	4,75	5,20	
6m	7,13	7,33	5,25	5,60	8,29	8,59	5,09	5,44	
9m	7,19	7,34	5,45	5,75	8,55	8,85	5,32	5,62	
12m	7,24	7,44	5,61	5,91	8,73	9,03	5,51	5,81	

Euribor fixings	
Date	22/08/2025
1w	1,899
1m	1,889
3m	2,017
6m	2,057
12m	2,084

FRAs				
	EUR	EUR	USD	USD
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	2,005	2,025	4,321	4,341
2x5	1,996	2,016	4,230	4,250
3x6	1,959	1,979	4,104	4,124
6x9	1,903	1,923	3,841	3,861
6x12	1,986	2,006	3,902	3,922
12x18	2,012	2,032	3,531	3,551
18x24	2,126	2,146		

* Please note that all rates are for indication only