

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	1,93	1,98	3,55	3,75	3,68	3,88	0,55	0,77	-0,12	0,08
1w	1,88	2,13	3,62	3,69	3,69	3,89	0,51	0,81	-0,25	0,11
2w	2,00	2,25	3,55	3,75	3,77	3,77	0,60	0,96	-0,25	0,08
1m	2,20	2,50	3,58	3,83	3,68	3,88	0,54	1,08	-0,13	0,17
2m	2,11	2,41	3,62	3,87	3,86	4,03	0,70	1,14	-0,12	0,08
3m	2,16	2,46	3,69	3,94	3,85	4,05	0,85	1,05	-0,07	0,13
4m	2,16	2,46	3,69	3,94	3,85	4,05	0,85	1,05	-0,07	0,13
5m	2,16	2,46	3,69	3,94	3,85	4,05	0,85	1,05	-0,07	0,13
6m	2,32	2,42	3,85	4,10	4,02	4,22	0,96	1,16	-0,14	0,06
7m	2,32	2,42	3,85	4,10	4,02	4,22	0,96	1,16	-0,14	0,06
8m	2,32	2,42	3,85	4,10	4,02	4,22	0,96	1,16	-0,14	0,06
9m	2,46	2,56	4,03	4,28	4,23	4,43	1,14	1,44	0,13	0,33
10m	2,46	2,56	4,03	4,28	4,23	4,43	1,14	1,44	0,13	0,33
11m	2,46	2,56	4,03	4,28	4,23	4,43	1,14	1,44	0,13	0,33
12m	2,69	2,81	4,18	4,43	4,37	4,57	1,20	1,40	0,06	0,26

Interest Rate Swaps										
	EUR		USD		GBP		JPY		CHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1y	2,808	2,814	3,917	3,944	4,177	4,197	1,200	1,400	0,060	0,085
2y	2,887	2,893	4,006	4,029	4,262	4,280	1,477	1,477	0,197	0,227
3y	2,888	2,894	3,935	3,985	4,251	4,271	1,688	1,688	0,276	0,306
4y	2,899	2,904	3,923	3,973	4,261	4,266	1,858	1,858	0,341	0,371
5y	2,909	2,934	3,923	3,973	4,277	4,282	2,005	2,005	0,400	0,430
6y	2,939	2,964	3,940	3,990	4,312	4,317	2,136	2,136	0,459	0,489
7y	2,975	2,995	3,966	4,016	4,356	4,361	2,259	2,259	0,516	0,546
8y	3,023	3,027	3,994	4,044	4,407	4,412	2,379	2,379	0,571	0,601
9y	3,061	3,065	4,023	4,073	4,461	4,466	2,490	2,490	0,623	0,653
10y	3,099	3,103	4,051	4,101	4,515	4,520	2,593	2,593	0,674	0,704
12y	3,150	3,190	4,111	4,161	4,616	4,621	2,773	2,773	0,762	0,792
15y	3,230	3,270	4,190	4,240	4,742	4,747	2,989	2,989	0,853	0,883
20y	3,272	3,312	4,251	4,301	4,867	4,872	3,248	3,248	0,930	0,960
25y	3,247	3,287	4,238	4,288	4,914	4,919	3,385	3,385	0,949	0,979
30y	3,199	3,239	4,193	4,243	4,911	4,916	3,444	3,444	0,931	0,961

Foreign exchange markets

Spot Rates		
EUR Majors		
	BID	ASK
EURUSD	1,1525	1,1526
EURGBP	0,8636	0,8641
EURJPY	184,64	184,65
EURCHF	0,9182	0,9186
EURCAD	1,6063	1,6064
USD Majors		
	BID	ASK
GBPUSD	1,3339	1,3346
USDJPY	160,20	160,21
USDCHF	0,7966	0,7971
USDCAD	1,3937	1,3939
NZDUSD	0,5806	0,5809
AUDUSD	0,7056	0,7058
Scandies		
	BID	ASK
EURNOK	10,8632	10,8699
EURDKK	7,4739	7,4741
EURSEK	10,8954	10,8966
Eastern EU		
	BID	ASK
EURPLN	4,2437	4,2448
EURHUF	356,02	356,29
EURCZK	24,209	24,217
EURTRY	52,8600	53,2600
EURRUB	84,710	84,719
Asia Pacific		
	BID	ASK
EURNZD	1,9840	1,9852
EURAUD	1,6329	1,6336
EURSGD	1,4863	1,4865
EURHKD	9,0292	9,0302
EURCNY	7,8202	7,8216

Crypto currency	\$ Price	Ytd%
Bitcoin	63119,6	-28,02

Forwards								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
O/N	0,49	0,59	0,40	0,42	-7,60	6,28	-0,56	-0,46
1w	3,62	3,80	2,87	2,89	-4,85	-4,76	-3,73	-3,69
2w	6,85	6,96	5,31	5,38	-9,83	-9,69	-7,96	-7,84
1m	14,35	14,47	11,18	11,30	-21,74	-21,43	-17,79	-17,56
2m	28,62	28,70	22,49	22,83	-44,56	-43,80	-36,95	-36,72
3m	42,41	42,99	34,15	34,40	-67,81	-67,39	-56,46	-56,09
6m	80,76	81,65	67,98	68,51	-144,37	-141,55	-117,12	-116,28
9m	120,44	121,97	103,35	104,46	-223,73	-216,43	-177,72	-175,55
12m	162,07	163,11	139,11	140,79	-298,11	-290,64	-237,88	-234,76

Volatilities ATM								
	EURUSD		EURGBP		EURJPY		EURCHF	
	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK	BID	ASK
1w	5,87	6,52	2,65	3,50	5,87	6,72	3,55	4,55
1m	5,67	5,77	3,40	3,70	6,34	6,84	3,75	4,15
2m	5,61	5,71	3,54	3,84	6,56	6,96	3,88	4,13
3m	5,55	5,65	3,54	3,94	6,60	6,95	3,90	4,25
6m	5,76	5,91	3,96	4,31	7,11	7,41	4,31	4,61
9m	5,99	6,14	4,26	4,51	7,39	7,84	4,50	4,90
12m	6,40	6,50	4,58	4,93	7,80	8,10	4,80	5,20

Euribor fixings	
Date	5/06/2026
1w	1,903
1m	2,009
3m	2,312
6m	2,584
12m	2,842

FRAs	EUR	EUR	USD	USD
	BID	ASK	BID	ASK
1x4	2,433	2,453	3,960	3,980
2x5	2,514	2,534	4,007	4,027
3x6	2,601	2,651	4,013	4,033
6x9	2,770	2,790	4,179	4,219
6x12	2,920	2,940	4,481	4,501
12x18	2,941	2,961	4,564	4,584
18x24	2,847	2,867		

* Please note that all rates are for indication only