



Yale SCHOOL OF MANAGEMENT  
*Program on Financial Stability*

## EliScholar – A Digital Platform for Scholarly Publishing at Yale

---

YPFS Resource Library

---

2022

### Money Market Rates / EURIBOR Twelve Month Funds / Daily Quotations

Deutsche Bundesbank / Central Bank of Germany

<https://elischolar.library.yale.edu/ypfs-documents2/299>

---

This resource is brought to you for free and open access by the Yale Program on Financial Stability and [EliScholar](#), a digital platform for scholarly publishing provided by Yale University Library. For more information, please contact [ypfs@yale.edu](mailto:ypfs@yale.edu).

Geldmarktsätze / Money market rates

Ab 1.1.2014 werden die Daten aus lizenzrechtlichen Gründen erst am nächsten Arbeitstag veröffentlicht.  
Data become fee liable from 1.1.2014 and therefore will be published with the delay of one working day.

% p.a.

Zeit / Period	EURIBOR @ 2)					
	€STR 1)	Wochengeld / One-week funds	Monatsgeld / One-month funds	Dreimonatsgeld / Three-month funds	Sechsmontagsgeld / Six-month funds	Zwölfmontagsgeld / Twelve-month funds
<b>Monatsdurchschnitte/ Monthly averages</b>						
2022 Mai	-0,585	-0,57	-0,55	-0,39	-0,14	0,29
Juni	-0,582	-0,57	-0,53	-0,24	0,16	0,85
Juli	-0,511	-0,46	-0,31	0,04	0,47	0,99
Aug.	-0,085	-0,07	0,02	0,40	0,84	1,25
Sept.	0,355	0,42	0,57	1,01	1,60	2,23
Okt.	0,656	0,70	0,92	1,43	2,00	2,63
Nov.	1,368	1,38	1,42	1,83	2,32	2,83
Dez.	1,568	1,60	1,72	2,06	2,56	3,02
2023 Jan.	1,902	1,89	1,98	2,35	2,86	3,34
Febr.	2,275	2,30	2,37	2,64	3,14	3,53
März	2,572	2,57	2,71	2,91	3,27	3,65
April	2,900	2,88	2,96	3,18	3,52	3,76
Mai	3,080	3,09	3,15	3,37	3,68	3,86
<b>Tageswerte/ Daily quotations</b>						
2023 April 12.	2,898	.	.	.	.	.
13.	2,899	.	.	.	.	.
14.	2,896	.	.	.	.	.
17.	2,897	.	.	.	.	.
18.	2,901	.	.	.	.	.
19.	2,902	.	.	.	.	.
20.	2,904	.	.	.	.	.
21.	2,902	.	.	.	.	.
24.	2,905	.	.	.	.	.
25.	2,901	.	.	.	.	.
26.	2,900	.	.	.	.	.
27.	2,900	.	.	.	.	.
28.	2,894	.	.	.	.	.
Mai 2.	2,896	.	.	.	.	.
3.	2,896	.	.	.	.	.
4.	2,897	.	.	.	.	.
5.	2,898	.	.	.	.	.
8.	2,892	.	.	.	.	.
9.	2,894	.	.	.	.	.
10.	3,145	.	.	.	.	.
11.	3,145	.	.	.	.	.
12.	3,148	.	.	.	.	.
15.	3,145	.	.	.	.	.
16.	3,147	.	.	.	.	.
17.	3,151	.	.	.	.	.
18.	3,153	.	.	.	.	.
19.	3,151	.	.	.	.	.
22.	3,150	.	.	.	.	.
23.	3,157	.	.	.	.	.
24.	3,148	.	.	.	.	.
25.	3,148	.	.	.	.	.
26.	3,152	.	.	.	.	.
29.	3,147	.	.	.	.	.
30.	3,148	.	.	.	.	.
31.	3,144	.	.	.	.	.
Juni 1.	3,147	.	.	.	.	.
2.	3,148	.	.	.	.	.
5.	3,148	.	.	.	.	.
6.	3,145	.	.	.	.	.
7.	3,144	.	.	.	.	.
8.	3,146	.	.	.	.	.
9.	3,147	.	.	.	.	.
12.	3,147	.	.	.	.	.
13.	3,147	.	.	.	.	.
14.	3,150	.	.	.	.	.

\* Weder Euribor EBF, noch Euribor ACI, noch die Referenzbanken, noch das Euribor Steering Committee, noch die Europäische Zentralbank, noch Reuters, noch die Deutsche Bundesbank können bei Unstimmigkeiten der EURIBOR Sätze haftbar gemacht werden. **1** Euro Short-Term Rate: Seit 2. Oktober 2019 veröffentlicht die Europäische Zentralbank auf Basis von getätigten Einzeltransaktionen vom vorherigen Handelstag, die in Euro denominiert sind, den €STR. Diese werden von berichtspflichtigen Banken im Zuge der Geldmarktstatistik gemeldet. Monatsdurchschnitte sind eigene Berechnungen der Deutschen Bundesbank. **2** Die Euribor @ Tageswerte können auf der Bundesbank Webseite aktuell nicht angeboten werden. Monatsdurchschnitte sind eigene Berechnungen der Deutschen Bundesbank auf der Grundlage der vom European Money Markets Institute (EMMI) ermittelten Euribor @ Tageswerte. Es handelt sich um ungewichtete Durchschnitte. Informationen zu den von EMMI administrierten Basisdaten sind hier abrufbar: <https://www.emmi-benchmarks.eu/benchmarks/euribor/methodology/>

\* Neither Euribor EBF, nor Euribor ACI, nor the Euribor Panel Banks, nor the Euribor Steering Committee, nor the European Central Bank, nor Reuters, nor the Deutsche Bundesbank can be held liable for any irregularity or inaccuracy of the EONIA rate and the EURIBOR rate. **1** Euro Short-Term Rate: on the basis of individual euro-denominated transactions conducted and settled on the previous business day, the European Central Bank publishes the €STR since 2 October 2019. Transactions are reported by euro area banks subject to reporting obligations in compliance with Money Market Statistical Reporting Regulation. Monthly averages are calculations by Deutsche Bundesbank. **2** Euribor @ daily rates are currently not available on the Bundesbank website. Monthly averages are own calculations by Deutsche Bundesbank based on Euribor @ daily rates calculated by the European Money Markets Institute (EMMI). These are unweighted averages. Information on the methodology of Euribor @ daily rates administered by EMMI is available here: <https://www.emmi-benchmarks.eu/benchmarks/euribor/methodology/>