

Indikationen für Swaps und Optionen

(21.05.2012, 17:16)



Swaps	EUR		USD		GBP		JPY		CHF						
	30/360 p.a.		30/360 s.a.		Act/365 s.a.		Act/365 s.a.		30/360 p.a.						
1 Jahr	0.982	-	0.992	0.55	-	0.60	1.29	-	1.34	0.32	-	0.37	0.10	-	0.15
2 Jahre	0.980	-	0.990	0.62	-	0.67	1.27	-	1.32	0.33	-	0.38	0.10	-	0.15
3 Jahre	1.070	-	1.080	0.71	-	0.76	1.30	-	1.35	0.34	-	0.39	0.16	-	0.21
4 Jahre	1.202	-	1.212	0.86	-	0.91	1.37	-	1.42	0.36	-	0.41	0.25	-	0.30
5 Jahre	1.355	-	1.365	1.05	-	1.10	1.47	-	1.52	0.41	-	0.46	0.36	-	0.41
7 Jahre	1.650	-	1.660	1.42	-	1.47	1.75	-	1.80	0.56	-	0.61	0.62	-	0.67
10 Jahre	1.962	-	1.972	1.82	-	1.87	2.20	-	2.25	0.85	-	0.90	0.94	-	0.99

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.96-0.97	0.97-0.98	1.03-1.04	1.11-1.12	1.43-1.44	1.80-1.81	2.16-2.17	2.44-2.45	3M-Euribor	0.682
3 Jahre	1.06-1.07	1.09-1.10	1.16-1.17	1.28-1.29	1.61-1.62	1.98-1.99	2.29-2.30	2.52-2.53	6M-Euribor	0.969
4 Jahre	1.21-1.22	1.24-1.25	1.31-1.32	1.45-1.46	1.79-1.80	2.12-2.13	2.38-2.39	2.59-2.60	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.36-1.37	1.40-1.41	1.48-1.49	1.62-1.63	1.93-1.94	2.22-2.23	2.46-2.47	2.64-2.65	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.66-1.67	1.70-1.71	1.76-1.77	1.89-1.90	2.15-2.16	2.39-2.40	2.58-2.59	2.74-2.75	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.97-1.98	2.00-2.01	2.06-2.07	2.16-2.17	2.37-2.38	2.56-2.57	2.70-2.71	2.79-2.80	6M-USD	0.7364

EUR Swaptions	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	FX-Märkte	
2 Jahre	11-12	19-20	28-29	42-44	73-77	101-108	122-131	133-144	1Eur=USD	1.2771
3 Jahre	18-19	31-33	45-48	67-71	114-122	153-164	180-194	195-212	1Eur=GBP	0.8082
4 Jahre	26-27	46-49	66-70	99-105	159-170	205-220	237-257	256-279	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	33-36	61-65	90-96	132-141	204-218	256-276	293-318	315-344	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	50-54	90-97	134-144	195-210	286-309	350-380	397-433	426-467	1Eur=JPY	101.29
10 Jahre	78-85	139-150	201-217	288-311	404-438	484-527	540-591	579-636	100JPY=Eur	0.9873

EUR Caps/Floors	2.50%	3.00%	3.50%	4.00%	4.50%	3.00%	2.75%	2.50%	2.25%	2.00%
2 Jahre	3-4	2-3	1-2	1-1	1-1	308-308	271-271	234-235	198-199	162-163
3 Jahre	16-19	11-14	8-10	6-8	5-6	491-493	431-434	372-375	314-316	256-260
4 Jahre	46-52	34-39	25-30	20-24	16-20	651-656	570-576	490-496	412-419	337-343
5 Jahre	94-105	72-82	56-65	44-53	36-44	788-798	688-698	590-601	496-506	404-415
7 Jahre	239-261	185-208	146-168	118-139	96-116	1012-1035	881-903	754-776	632-653	516-536
10 Jahre	507-550	401-447	321-367	261-307	215-259	1299-1344	1127-1171	963-1006	808-849	662-700