

# Indikationen für Swaps und Optionen

(22.05.2012, 16:12)



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	0.963	- 0.973	0.54	- 0.59	1.28	- 1.33	0.32	- 0.37	0.10	- 0.15
2 Jahre	0.961	- 0.971	0.61	- 0.66	1.25	- 1.30	0.32	- 0.37	0.09	- 0.14
3 Jahre	1.052	- 1.062	0.71	- 0.76	1.29	- 1.34	0.33	- 0.38	0.16	- 0.21
4 Jahre	1.192	- 1.202	0.88	- 0.93	1.36	- 1.41	0.36	- 0.41	0.26	- 0.31
5 Jahre	1.352	- 1.362	1.08	- 1.13	1.47	- 1.52	0.41	- 0.46	0.37	- 0.42
7 Jahre	1.651	- 1.661	1.47	- 1.52	1.76	- 1.81	0.56	- 0.61	0.65	- 0.70
10 Jahre	1.967	- 1.977	1.89	- 1.94	2.21	- 2.26	0.86	- 0.91	0.96	- 1.01
EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.94-0.95	0.95-0.96	1.01-1.02	1.10-1.11	1.43-1.44	1.82-1.83	2.18-2.19	2.45-2.46	3M-Euribor	0.681
3 Jahre	1.05-1.06	1.07-1.08	1.14-1.15	1.27-1.28	1.62-1.63	1.99-2.00	2.30-2.31	2.54-2.55	6M-Euribor	0.966
4 Jahre	1.20-1.21	1.23-1.24	1.31-1.32	1.45-1.46	1.80-1.81	2.13-2.14	2.40-2.41	2.60-2.61	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.36-1.37	1.40-1.41	1.48-1.49	1.62-1.63	1.95-1.96	2.24-2.25	2.48-2.49	2.65-2.66	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.66-1.67	1.70-1.71	1.77-1.78	1.90-1.91	2.16-2.17	2.40-2.41	2.60-2.61	2.75-2.76	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.98-1.99	2.01-2.02	2.06-2.07	2.17-2.18	2.38-2.39	2.57-2.58	2.71-2.72	2.80-2.81	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	72-77	100-107	121-130	132-143	1Eur=USD	1.2768
3 Jahre	18-19	31-33	45-48	67-72	114-121	152-163	179-193	195-211	1Eur=GBP	0.8077
4 Jahre	25-27	46-49	66-70	99-106	159-170	203-219	237-256	255-278	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	32-35	60-65	90-96	132-141	204-218	255-275	293-317	314-343	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	49-53	91-98	135-144	196-210	286-309	349-379	396-432	425-466	1Eur=JPY	102.04
10 Jahre	78-85	140-151	204-219	289-311	405-439	482-526	538-589	578-635	100JPY=Eur	0.98
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	4-4	2-3	2-2	1-2	1-1	312-312	275-276	238-239	202-203	166-167
3 Jahre	16-19	11-13	8-10	6-7	4-6	496-498	436-438	377-379	318-321	261-264
4 Jahre	45-51	33-38	24-29	19-23	15-19	654-659	573-578	493-499	415-421	339-346
5 Jahre	94-104	70-80	54-64	43-52	35-43	788-798	689-699	591-602	496-507	405-416
7 Jahre	237-260	183-206	144-166	116-137	94-114	1010-1033	879-901	752-774	630-652	515-536
10 Jahre	507-550	399-445	318-365	258-304	212-256	1292-1338	1121-1166	958-1001	803-844	659-697