

Indikationen für Swaps und Optionen

(23.05.2012, 11:32)



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	0.948	- 0.958	0.55	- 0.60	1.26	- 1.31	0.32	- 0.37	0.08	- 0.13
2 Jahre	0.934	- 0.944	0.61	- 0.66	1.21	- 1.26	0.33	- 0.38	0.07	- 0.12
3 Jahre	1.020	- 1.030	0.71	- 0.76	1.23	- 1.28	0.34	- 0.39	0.12	- 0.17
4 Jahre	1.154	- 1.164	0.87	- 0.92	1.31	- 1.36	0.36	- 0.41	0.22	- 0.27
5 Jahre	1.311	- 1.321	1.07	- 1.12	1.42	- 1.47	0.40	- 0.45	0.34	- 0.39
7 Jahre	1.611	- 1.621	1.45	- 1.50	1.71	- 1.76	0.55	- 0.60	0.61	- 0.66
10 Jahre	1.927	- 1.937	1.85	- 1.90	2.17	- 2.22	0.86	- 0.91	0.93	- 0.98

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.91-0.92	0.92-0.93	0.97-0.98	1.06-1.07	1.38-1.39	1.77-1.78	2.14-2.15	2.41-2.42	3M-Euribor	0.68
3 Jahre	1.01-1.02	1.04-1.05	1.10-1.11	1.23-1.24	1.57-1.58	1.95-1.96	2.26-2.27	2.49-2.50	6M-Euribor	0.964
4 Jahre	1.16-1.17	1.19-1.20	1.26-1.27	1.41-1.42	1.75-1.76	2.08-2.09	2.36-2.37	2.56-2.57	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.32-1.33	1.36-1.37	1.43-1.44	1.58-1.59	1.90-1.91	2.19-2.20	2.43-2.44	2.61-2.62	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.62-1.63	1.66-1.67	1.72-1.73	1.85-1.86	2.12-2.13	2.36-2.37	2.55-2.56	2.70-2.71	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.94-1.95	1.97-1.98	2.02-2.03	2.12-2.13	2.33-2.34	2.51-2.52	2.65-2.66	2.74-2.75	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	20-21	28-29	41-44	70-75	97-104	117-126	130-140	1Eur=USD	1.2652
3 Jahre	18-19	31-33	44-47	66-71	110-118	148-158	175-188	190-207	1Eur=GBP	0.8049
4 Jahre	25-26	45-48	64-68	97-104	154-165	198-213	231-250	251-273	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	31-33	58-62	87-93	130-139	198-213	249-269	287-311	310-338	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	47-51	87-94	130-140	193-207	280-302	342-372	389-424	420-460	1Eur=JPY	100.44
10 Jahre	75-81	135-146	197-213	286-308	398-432	474-517	530-580	569-625	100JPY=Eur	0.9956

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	4-5	3-3	2-2	1-2	1-1	317-318	280-281	243-244	207-208	171-172
3 Jahre	16-19	11-14	8-10	6-8	5-6	505-507	445-448	386-389	327-330	270-273
4 Jahre	42-48	31-36	23-28	18-22	14-18	667-672	586-591	505-511	427-433	351-357
5 Jahre	87-98	66-75	50-60	40-48	32-39	803-813	703-713	605-615	509-520	417-428
7 Jahre	225-247	173-195	136-157	108-129	88-107	1028-1050	896-918	767-789	644-666	527-548
10 Jahre	486-528	381-426	303-348	244-289	199-243	1312-1357	1139-1183	974-1017	818-858	671-709