

# Indikationen für Swaps und Optionen

(23.05.2012, 11:47)



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	0.947	- 0.957	0.55	- 0.60	1.26	- 1.31	0.32	- 0.37	0.08	- 0.13
2 Jahre	0.930	- 0.940	0.61	- 0.66	1.21	- 1.26	0.33	- 0.38	0.06	- 0.11
3 Jahre	1.013	- 1.023	0.70	- 0.75	1.23	- 1.28	0.34	- 0.39	0.12	- 0.17
4 Jahre	1.146	- 1.156	0.87	- 0.92	1.30	- 1.35	0.36	- 0.41	0.21	- 0.26
5 Jahre	1.301	- 1.311	1.06	- 1.11	1.41	- 1.46	0.40	- 0.45	0.33	- 0.38
7 Jahre	1.598	- 1.608	1.44	- 1.49	1.70	- 1.75	0.55	- 0.60	0.60	- 0.65
10 Jahre	1.911	- 1.921	1.84	- 1.89	2.16	- 2.21	0.86	- 0.91	0.92	- 0.97

  

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.90-0.91	0.91-0.92	0.96-0.97	1.05-1.06	1.37-1.38	1.75-1.76	2.12-2.13	2.39-2.40	3M-Euribor	0.68
3 Jahre	1.01-1.02	1.03-1.04	1.09-1.10	1.22-1.23	1.56-1.57	1.93-1.94	2.24-2.25	2.47-2.48	6M-Euribor	0.964
4 Jahre	1.15-1.16	1.18-1.19	1.25-1.26	1.40-1.41	1.74-1.75	2.06-2.07	2.34-2.35	2.54-2.55	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.31-1.32	1.35-1.36	1.42-1.43	1.57-1.58	1.88-1.89	2.17-2.18	2.41-2.42	2.59-2.60	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.61-1.62	1.64-1.65	1.71-1.72	1.84-1.85	2.10-2.11	2.34-2.35	2.53-2.54	2.68-2.69	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.92-1.93	1.95-1.96	2.00-2.01	2.11-2.12	2.31-2.32	2.50-2.51	2.63-2.64	2.72-2.73	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	41-43	70-74	97-103	116-125	129-139	1Eur=USD	1.2645
3 Jahre	18-19	31-33	44-46	66-70	109-117	146-157	173-187	189-205	1Eur=GBP	0.8043
4 Jahre	25-26	45-47	63-67	96-103	153-164	197-212	229-248	249-271	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	31-33	58-62	86-92	129-138	197-211	247-267	285-309	307-336	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	46-50	86-93	129-139	191-205	278-299	340-369	387-422	417-457	1Eur=JPY	100.39
10 Jahre	74-81	134-145	196-211	284-306	395-429	471-514	526-576	566-621	100JPY=Eur	0.9961

  

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	3-3	2-2	1-2	1-1	318-318	281-281	244-245	208-208	171-172
3 Jahre	16-18	11-13	8-10	6-8	5-6	507-509	447-449	388-390	329-332	271-274
4 Jahre	41-47	30-35	23-27	18-22	14-17	669-675	588-593	508-513	429-435	353-359
5 Jahre	86-96	64-74	49-58	39-47	31-38	807-817	706-716	608-618	512-523	420-430
7 Jahre	221-243	170-192	133-154	106-126	86-105	1033-1055	900-922	772-793	648-669	531-551
10 Jahre	477-519	373-418	296-341	239-283	195-237	1320-1364	1146-1190	980-1023	823-863	675-713