

Indikationen für Swaps und Optionen

(18.05.2012, 18:37)



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	0.993	-	1.003	0.57	-	0.62	1.33	-	1.38	0.32	-	0.37	0.06	-	0.11
2 Jahre	0.990	-	1.000	0.63	-	0.68	1.30	-	1.35	0.33	-	0.38	0.06	-	0.11
3 Jahre	1.071	-	1.081	0.72	-	0.77	1.33	-	1.38	0.34	-	0.39	0.12	-	0.17
4 Jahre	1.198	-	1.208	0.88	-	0.93	1.39	-	1.44	0.36	-	0.41	0.21	-	0.26
5 Jahre	1.348	-	1.358	1.06	-	1.11	1.48	-	1.53	0.40	-	0.45	0.32	-	0.37
7 Jahre	1.639	-	1.649	1.42	-	1.47	1.74	-	1.79	0.54	-	0.59	0.58	-	0.63
10 Jahre	1.947	-	1.957	1.82	-	1.87	2.18	-	2.23	0.83	-	0.88	0.87	-	0.92

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.97-0.98	0.98-0.99	1.03-1.04	1.11-1.12	1.41-1.42	1.78-1.79	2.14-2.15	2.42-2.43	3M-Euribor	0.684
3 Jahre	1.07-1.08	1.09-1.10	1.15-1.16	1.27-1.28	1.59-1.60	1.95-1.96	2.26-2.27	2.50-2.51	6M-Euribor	0.972
4 Jahre	1.20-1.21	1.24-1.25	1.30-1.31	1.44-1.45	1.77-1.78	2.09-2.10	2.36-2.37	2.56-2.57	3M-CHF	0.1117
5 Jahre	1.36-1.37	1.39-1.40	1.47-1.48	1.61-1.62	1.91-1.92	2.20-2.21	2.43-2.44	2.62-2.63	6M-CHF	0.185
7 Jahre	1.65-1.66	1.68-1.69	1.75-1.76	1.87-1.88	2.13-2.14	2.36-2.37	2.56-2.57	2.72-2.73	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.96-1.97	1.99-2.00	2.04-2.05	2.14-2.15	2.35-2.36	2.54-2.55	2.68-2.69	2.78-2.79	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	19-21	28-29	41-44	72-76	100-107	121-130	132-142	1Eur=USD	1.2731
3 Jahre	17-18	31-33	45-48	67-71	113-120	151-162	178-192	193-210	1Eur=GBP	0.8059
4 Jahre	24-25	45-48	65-69	98-104	157-168	202-217	235-254	254-276	1Eur=CHF	1.2011
5 Jahre	31-33	60-64	89-95	131-140	201-216	253-273	290-315	313-341	100CHF=Eur	83.257
7 Jahre	47-50	89-96	132-142	194-208	283-305	346-376	394-429	424-464	1Eur=JPY	100.73
10 Jahre	73-79	138-149	199-215	286-309	401-435	480-523	537-588	577-634	100JPY=Eur	0.9928

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	306-307	269-270	233-233	196-197	160-161
3 Jahre	16-19	11-13	8-10	6-8	5-6	490-493	431-433	371-374	313-316	256-259
4 Jahre	44-50	33-38	25-29	19-23	15-19	652-657	571-576	491-497	413-419	337-343
5 Jahre	92-102	70-80	54-63	43-51	35-43	790-799	690-700	592-602	497-507	405-416
7 Jahre	233-255	181-203	143-165	115-136	94-113	1016-1038	884-906	756-778	634-655	517-538
10 Jahre	497-540	393-437	314-359	255-300	210-253	1305-1350	1132-1176	968-1010	811-852	664-702