

Indikationen für Swaps und Optionen

(03.09.2010, 18:05)



Swaps	EUR			USD			GBP			JPY			CHF		
	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	Act/365 s.a.	Act/365 s.a.	4 Jahre	5 Jahre	30/360 p.a.	30/360 p.a.	30/360 p.a.	30/360 p.a.	
1 Jahr	1.189	- 1.201	0.41	- 0.46	1.05	- 1.10	0.40	- 0.45			0.31	- 0.36			
2 Jahre	1.315	- 1.327	0.68	- 0.73	1.24	- 1.29	0.41	- 0.46			0.54	- 0.59			
3 Jahre	1.507	- 1.519	1.01	- 1.06	1.53	- 1.58	0.44	- 0.49			0.73	- 0.78			
4 Jahre	1.712	- 1.724	1.35	- 1.40	1.83	- 1.88	0.49	- 0.54			0.92	- 0.97			
5 Jahre	1.914	- 1.926	1.68	- 1.73	2.10	- 2.15	0.56	- 0.61			1.10	- 1.15			
7 Jahre	2.260	- 2.272	2.20	- 2.25	2.56	- 2.61	0.79	- 0.84			1.41	- 1.46			
10 Jahre	2.617	- 2.629	2.68	- 2.73	3.06	- 3.11	1.18	- 1.23			1.73	- 1.78			
EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings						
2 Jahre	1.34-1.35	1.39-1.40	1.47-1.48	1.66-1.67	2.12-2.13	2.57-2.58	2.92-2.93	3.20-3.21	3M-Euribor	0.883					
3 Jahre	1.53-1.54	1.59-1.60	1.68-1.69	1.89-1.90	2.34-2.35	2.73-2.74	3.05-3.06	3.30-3.31	6M-Euribor	1.134					
4 Jahre	1.74-1.75	1.80-1.81	1.90-1.91	2.11-2.12	2.51-2.52	2.88-2.89	3.16-3.17	3.37-3.38	3M-CHF	0.1667					
5 Jahre	1.94-1.95	2.00-2.01	2.10-2.11	2.29-2.30	2.67-2.68	2.99-3.00	3.24-3.25	3.42-3.43	6M-CHF	0.235					
7 Jahre	2.28-2.29	2.34-2.35	2.42-2.43	2.59-2.60	2.90-2.91	3.16-3.17	3.36-3.37	3.51-3.52	3M-USD	0.2928					
10 Jahre	2.64-2.65	2.68-2.69	2.74-2.75	2.87-2.88	3.12-3.13	3.32-3.33	3.46-3.47	3.55-3.56	6M-USD	0.4936					
EUR Swaptions	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	FX-Märkte						
2 Jahre	11-12	22-24	34-37	55-59	83-89	100-110	110-122	115-129	1Eur=USD	1.2885					
3 Jahre	19-21	36-39	54-58	84-91	122-133	147-161	160-179	168-190	1Eur=GBP	0.8343					
4 Jahre	28-30	53-57	76-82	113-122	162-178	195-216	210-236	221-250	1Eur=CHF	1.3108					
5 Jahre	38-41	71-77	101-109	143-156	203-223	242-268	260-292	272-308	100CHF=Eur	76.2893					
7 Jahre	59-64	103-112	144-157	205-224	284-313	333-371	359-404	373-423	1Eur=JPY	108.84					
10 Jahre	93-101	157-171	215-235	298-328	407-450	467-522	503-566	521-590	100JPY=Eur	0.9188					
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	8-10	5-6	3-4	2-3	2-2	252-254	216-218	181-182	146-147	112-114					
3 Jahre	38-43	26-30	18-22	14-17	10-13	385-389	329-333	273-278	220-225	170-175					
4 Jahre	90-99	63-72	46-55	35-43	27-34	486-495	412-422	342-351	275-284	212-221					
5 Jahre	163-178	116-131	85-99	64-78	50-62	564-579	477-492	394-409	317-331	246-260					
7 Jahre	359-386	259-289	190-220	142-171	110-137	684-714	576-605	477-505	386-412	305-328					
10 Jahre	713-762	529-584	390-448	290-349	222-279	830-885	703-755	586-634	482-527	388-428					