

# Indikationen für Swaps und Optionen

(08.02.2012, 09:35)



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	1.219	- 1.229	0.47	- 0.52	1.26	- 1.31	0.32	- 0.37	0.08	- 0.13
2 Jahre	1.147	- 1.157	0.52	- 0.57	1.25	- 1.30	0.33	- 0.38	0.08	- 0.13
3 Jahre	1.233	- 1.243	0.63	- 0.68	1.33	- 1.38	0.36	- 0.41	0.14	- 0.19
4 Jahre	1.404	- 1.414	0.83	- 0.88	1.46	- 1.51	0.40	- 0.45	0.28	- 0.33
5 Jahre	1.607	- 1.617	1.08	- 1.13	1.63	- 1.68	0.46	- 0.51	0.44	- 0.49
7 Jahre	1.980	- 1.990	1.57	- 1.62	2.00	- 2.05	0.65	- 0.70	0.77	- 0.82
10 Jahre	2.352	- 2.362	2.07	- 2.12	2.47	- 2.52	0.98	- 1.03	1.13	- 1.18

  

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	1.11-1.12	1.11-1.12	1.14-1.15	1.24-1.25	1.67-1.68	2.20-2.21	2.66-2.67	2.99-3.00	3M-Euribor	1.086
3 Jahre	1.22-1.23	1.24-1.25	1.30-1.31	1.47-1.48	1.93-1.94	2.41-2.42	2.81-2.82	3.08-3.09	6M-Euribor	1.385
4 Jahre	1.41-1.42	1.44-1.45	1.52-1.53	1.71-1.72	2.15-2.16	2.58-2.59	2.92-2.93	3.15-3.16	3M-CHF	0.0767
5 Jahre	1.62-1.63	1.66-1.67	1.74-1.75	1.93-1.94	2.34-2.35	2.71-2.72	3.00-3.01	3.20-3.21	6M-CHF	0.1308
7 Jahre	1.99-2.00	2.03-2.04	2.10-2.11	2.27-2.28	2.60-2.61	2.89-2.90	3.13-3.14	3.30-3.31	3M-USD	0.52
10 Jahre	2.36-2.37	2.39-2.40	2.45-2.46	2.58-2.59	2.84-2.85	3.07-3.08	3.24-3.25	3.34-3.35	6M-USD	0.766

  

EUR Swaptions	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	FX-Märkte	
2 Jahre	11-11	19-20	28-30	43-46	73-78	99-108	117-128	129-143	1Eur=USD	1.327
3 Jahre	18-20	31-33	46-49	70-75	114-123	150-163	174-191	188-209	1Eur=GBP	0.8336
4 Jahre	26-28	44-47	64-69	102-109	157-171	199-218	227-251	244-272	1Eur=CHF	1.2113
5 Jahre	35-37	58-63	86-93	134-145	202-220	249-273	280-310	299-334	100CHF=Eur	82.5559
7 Jahre	53-58	88-96	129-140	194-211	280-307	340-376	379-422	404-453	1Eur=JPY	102.26
10 Jahre	82-90	136-148	198-216	289-316	398-439	466-517	513-573	548-615	100JPY=Eur	0.9779

  

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	2-2	1-1	0-1	0-0	0-0	293-294	256-257	219-220	182-183	146-147
3 Jahre	14-17	9-11	6-7	4-5	3-4	459-461	400-402	341-343	283-286	227-230
4 Jahre	50-57	35-41	24-30	17-22	13-17	591-597	512-518	435-441	360-367	288-295
5 Jahre	115-127	82-94	60-71	44-54	34-42	694-705	599-611	507-519	419-431	336-347
7 Jahre	307-331	230-255	173-199	131-156	102-125	853-879	734-760	621-645	514-537	414-436
10 Jahre	645-691	496-546	379-432	292-345	228-279	1049-1099	902-950	764-809	635-677	516-555