

# Indikationen für Swaps und Optionen

(21.05.2012, 18:01)



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	0.980	- 0.990	0.55	- 0.60	1.29	- 1.34	0.32	- 0.37	0.09	- 0.14
2 Jahre	0.979	- 0.989	0.61	- 0.66	1.27	- 1.32	0.33	- 0.38	0.09	- 0.14
3 Jahre	1.068	- 1.078	0.71	- 0.76	1.29	- 1.34	0.34	- 0.39	0.15	- 0.20
4 Jahre	1.201	- 1.211	0.86	- 0.91	1.37	- 1.42	0.36	- 0.41	0.24	- 0.29
5 Jahre	1.356	- 1.366	1.05	- 1.10	1.47	- 1.52	0.40	- 0.45	0.36	- 0.41
7 Jahre	1.651	- 1.661	1.42	- 1.47	1.75	- 1.80	0.55	- 0.60	0.61	- 0.66
10 Jahre	1.963	- 1.973	1.82	- 1.87	2.20	- 2.25	0.84	- 0.89	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	0.96-0.97	0.97-0.98	1.03-1.04	1.11-1.12	1.43-1.44	1.81-1.82	2.17-2.18	2.44-2.45	3M-Euribor	0.682
3 Jahre	1.06-1.07	1.09-1.10	1.15-1.16	1.28-1.29	1.62-1.63	1.98-1.99	2.29-2.30	2.52-2.53	6M-Euribor	0.969
4 Jahre	1.21-1.22	1.24-1.25	1.31-1.32	1.45-1.46	1.79-1.80	2.12-2.13	2.39-2.40	2.58-2.59	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.37-1.38	1.40-1.41	1.48-1.49	1.62-1.63	1.94-1.95	2.23-2.24	2.46-2.47	2.64-2.65	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.66-1.67	1.70-1.71	1.76-1.77	1.89-1.90	2.15-2.16	2.39-2.40	2.59-2.60	2.74-2.75	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.97-1.98	2.00-2.01	2.06-2.07	2.16-2.17	2.37-2.38	2.56-2.57	2.70-2.71	2.79-2.80	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	12-12	20-21	28-30	42-45	72-76	100-106	120-129	132-142	1Eur=USD	1.2773
3 Jahre	18-19	32-34	45-48	68-72	113-120	151-162	178-192	194-210	1Eur=GBP	0.8089
4 Jahre	25-27	46-49	66-70	99-106	157-168	202-218	235-255	254-276	1Eur=CHF	1.2011
5 Jahre	33-35	61-65	89-95	132-141	202-217	254-274	291-315	313-341	100CHF=Eur	83.257
7 Jahre	50-54	91-98	134-144	195-210	284-307	348-377	395-430	424-465	1Eur=JPY	101.32
10 Jahre	79-86	140-151	202-218	288-311	403-437	481-524	536-588	576-633	100JPY=Eur	0.987

  

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	308-309	271-272	235-236	198-199	163-164
3 Jahre	16-19	11-14	8-10	6-8	5-6	491-494	432-434	372-375	314-317	257-260
4 Jahre	45-51	33-38	24-29	19-23	15-19	650-655	569-575	489-495	411-418	336-342
5 Jahre	93-103	70-80	54-63	42-51	34-42	785-795	685-696	588-599	493-504	402-413
7 Jahre	235-257	181-204	143-165	114-135	93-113	1008-1030	877-899	749-772	628-649	512-533
10 Jahre	502-544	395-440	315-361	255-300	209-253	1291-1336	1120-1164	956-999	801-842	656-694