

# Indikationen für Swaps und Optionen

(23.05.2012, 15:47)



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	0.936	- 0.946	0.55	- 0.60	1.24	- 1.29	0.32	- 0.37	0.08	- 0.13
2 Jahre	0.910	- 0.920	0.62	- 0.67	1.19	- 1.24	0.33	- 0.38	0.06	- 0.11
3 Jahre	0.989	- 0.999	0.71	- 0.76	1.21	- 1.26	0.34	- 0.39	0.11	- 0.16
4 Jahre	1.119	- 1.129	0.87	- 0.92	1.27	- 1.32	0.36	- 0.41	0.20	- 0.25
5 Jahre	1.271	- 1.281	1.06	- 1.11	1.38	- 1.43	0.40	- 0.45	0.31	- 0.36
7 Jahre	1.567	- 1.577	1.43	- 1.48	1.67	- 1.72	0.55	- 0.60	0.58	- 0.63
10 Jahre	1.878	- 1.888	1.83	- 1.88	2.12	- 2.17	0.85	- 0.90	0.89	- 0.94

  

EUR Forward Swaps	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	4 Jahre	5 Jahre	Geldmarktfixings	
2 Jahre	0.88-0.89	0.89-0.90	0.94-0.95	1.02-1.03	1.34-1.35	1.72-1.73	2.08-2.09	2.35-2.36	3M-Euribor	0.68
3 Jahre	0.98-0.99	1.00-1.01	1.06-1.07	1.18-1.19	1.52-1.53	1.89-1.90	2.20-2.21	2.44-2.45	6M-Euribor	0.964
4 Jahre	1.12-1.13	1.15-1.16	1.22-1.23	1.36-1.37	1.70-1.71	2.03-2.04	2.30-2.31	2.50-2.51	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.28-1.29	1.32-1.33	1.39-1.40	1.53-1.54	1.84-1.85	2.14-2.15	2.37-2.38	2.55-2.56	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.58-1.59	1.61-1.62	1.68-1.69	1.80-1.81	2.06-2.07	2.30-2.31	2.49-2.50	2.63-2.64	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.89-1.90	1.92-1.93	1.97-1.98	2.07-2.08	2.27-2.28	2.45-2.46	2.58-2.59	2.67-2.68	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	19-20	27-28	40-42	68-72	95-101	114-123	127-137	1Eur=USD	1.2645
3 Jahre	17-18	30-32	43-45	64-68	107-114	144-154	170-184	186-203	1Eur=GBP	0.8043
4 Jahre	24-26	44-46	62-66	94-100	150-161	194-208	226-245	246-268	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	30-32	57-61	84-90	126-135	193-207	244-263	281-305	303-331	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	46-49	85-91	127-136	188-202	273-295	335-363	381-416	411-451	1Eur=JPY	100.35
10 Jahre	73-79	132-143	193-208	279-301	389-422	464-506	518-567	556-611	100JPY=Eur	0.9965

  

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	2-2	1-2	1-1	321-322	284-285	248-248	211-212	175-176
3 Jahre	14-17	10-12	7-9	5-7	4-5	513-515	453-455	393-396	334-337	276-279
4 Jahre	39-44	28-33	21-25	16-20	13-16	678-683	596-601	516-521	436-442	359-365
5 Jahre	81-91	60-70	46-55	36-44	29-36	818-827	717-726	618-627	521-531	428-438
7 Jahre	212-233	162-184	127-147	101-121	81-100	1047-1069	913-935	784-805	659-680	540-560
10 Jahre	460-502	360-404	285-329	229-273	187-228	1338-1382	1163-1206	995-1037	835-876	686-723