

Indikationen für Swaps und Optionen

(22.05.2012, 18:12)



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	0.955	- 0.965	0.54	- 0.59	1.27	- 1.32	0.32	- 0.37	0.09	- 0.14
2 Jahre	0.942	- 0.952	0.61	- 0.66	1.24	- 1.29	0.32	- 0.37	0.08	- 0.13
3 Jahre	1.032	- 1.042	0.71	- 0.76	1.28	- 1.33	0.33	- 0.38	0.15	- 0.20
4 Jahre	1.173	- 1.183	0.88	- 0.93	1.36	- 1.41	0.36	- 0.41	0.25	- 0.30
5 Jahre	1.335	- 1.345	1.08	- 1.13	1.46	- 1.51	0.41	- 0.46	0.37	- 0.42
7 Jahre	1.636	- 1.646	1.47	- 1.52	1.75	- 1.80	0.56	- 0.61	0.64	- 0.69
10 Jahre	1.953	- 1.963	1.89	- 1.94	2.21	- 2.26	0.86	- 0.91	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	0.92-0.93	0.93-0.94	0.98-0.99	1.07-1.08	1.41-1.42	1.81-1.82	2.17-2.18	2.44-2.45	3M-Euribor	0.681
3 Jahre	1.02-1.03	1.05-1.06	1.12-1.13	1.25-1.26	1.61-1.62	1.98-1.99	2.29-2.30	2.52-2.53	6M-Euribor	0.966
4 Jahre	1.18-1.19	1.21-1.22	1.29-1.30	1.43-1.44	1.79-1.80	2.12-2.13	2.39-2.40	2.59-2.60	3M-CHF	0.1133
5 Jahre	1.34-1.35	1.38-1.39	1.46-1.47	1.61-1.62	1.93-1.94	2.23-2.24	2.47-2.48	2.64-2.65	6M-CHF	0.1867
7 Jahre	1.65-1.66	1.68-1.69	1.75-1.76	1.88-1.89	2.15-2.16	2.39-2.40	2.59-2.60	2.73-2.74	3M-USD	0.4669
10 Jahre	1.96-1.97	1.99-2.00	2.05-2.06	2.15-2.16	2.37-2.38	2.55-2.56	2.70-2.71	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	20-21	28-30	42-44	72-76	100-106	119-128	131-141	1Eur=USD	1.2726
3 Jahre	18-19	31-33	45-48	67-72	113-120	150-161	177-191	192-209	1Eur=GBP	0.807
4 Jahre	25-26	45-48	65-69	99-105	157-168	202-217	234-254	253-276	1Eur=CHF	1.201
5 Jahre	31-33	59-63	89-95	132-141	202-216	253-273	290-315	312-341	100CHF=Eur	83.2639
7 Jahre	47-51	87-94	132-142	195-209	284-306	347-376	394-429	424-465	1Eur=JPY	101.78
10 Jahre	75-81	135-146	200-216	288-311	404-438	481-524	537-588	576-633	100JPY=Eur	0.9825

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	316-316	279-280	242-243	206-207	170-171
3 Jahre	17-19	12-14	9-11	7-8	5-6	503-505	443-445	384-386	325-328	268-271
4 Jahre	45-51	33-38	25-30	19-24	15-19	662-667	581-586	501-507	423-429	347-353
5 Jahre	93-103	70-80	54-63	42-51	34-42	796-806	696-706	598-609	503-514	412-423
7 Jahre	234-256	180-203	142-164	113-134	92-112	1018-1040	886-909	759-781	637-659	521-542
10 Jahre	500-542	392-438	312-358	252-297	206-250	1299-1344	1128-1172	964-1007	809-850	664-702