

FX Swaps

Stand 16.05.2012



Symbol	Long Swap Rate	Short Swap Rate
AUDCAD	3,80	-12,20
AUDCHF	6,80	-15,10
AUDJPY	6,60	-14,90
AUDNZD	-0,50	-7,80
AUDUSD	6,30	-14,70
CADCHF	-1,20	-7,10
CADJPY	-1,40	-6,90
CHFJPY	-4,40	-4,00
EURAUD	-14,40	6,00
EURCAD	-6,40	-2,00
EURCHF	-3,40	-4,90
EURCZK	-5,90	-2,50
EURGBP	-5,10	-3,20
EURHUF	-23,00	14,70
EURJPY	-3,60	-4,70
EURNOK	-8,50	0,20
EURNZD	-10,70	2,40
EURPLN	-16,60	8,20
EURSEK	-8,50	0,10
EURUSD	-3,90	-4,50
GBPAUD	-13,40	5,10
GBPCAD	-5,40	-2,90
GBPCHF	-2,50	-5,90
GBPJPY	-2,70	-5,70
GBPNZD	-9,80	1,40
GBPUSD	-2,90	-5,40
NOKSEK	-4,10	-4,20
NZDJPY	2,90	-11,30
NZDUSD	2,70	-11,00
USDCAD	-6,70	-1,70
USDCHF	-3,70	-4,60
USDCZK	-6,10	-2,20
USDHUF	-23,30	15,00
USDJPY	-3,90	-4,40
USDNOK	-8,80	0,50
USDSEK	-8,80	0,40
USDZAR	-18,80	10,40