

Tržní data – sazby a měny

29.3.2007						29.3.2007					
Pribor	bid	ask	1D	1T	3M	Swaps	bid	ask	1D	1T	3M
			27.III.07	21.III.07	28.XI.06				27.III.07	21.III.07	28.XI.06
O/N	2,39	2,49	4	0	11	1Y	2,82	2,88	-4	-8	-17
1W	2,42	2,52	1	0	1	2Y	3,05	3,11	-1	-5	-15
2W	2,42	2,52	0	0	1	3Y	3,20	3,26	-1	-4	-11
1M	2,44	2,54	0	0	2	4Y	3,34	3,40	-1	-4	-6
2M	2,45	2,55	0	1	0	5Y	3,44	3,50	-3	-5	-2
3M	2,47	2,57	1	2	-5	6Y	3,54	3,60	-3	-5	1
6M	2,56	2,66	1	2	-9	7Y	3,62	3,68	-1	-3	0
9M	2,66	2,76	1	3	-11	8Y	3,70	3,76	-1	-3	5
12M	2,76	2,86	1	5	-12	10Y	3,82	3,88	-1	-4	9

29.3.2007						29.3.2007					
FRA	bid	ask	1D	1T	3M	Libor	USD	EUR	JPY	CHF	GBP
			27.III.07	21.III.07	28.XI.06						
1*4	2,57	2,62	0	-3	-7	O/N	5,31	3,83	0,78	2,17	5,34
2*5	2,59	2,65	-4	3	-2	1M	5,32	3,87	0,68	2,22	5,46
3*6	2,69	2,75	1	2	-6	2M	5,34	3,88	0,68	2,26	5,53
4*7	2,76	2,82	0	2	-6	3M	5,35	3,92	0,68	2,29	5,59
5*8	2,81	2,87	0	1	-10	6M	5,32	4,03	0,71	2,39	5,70
6*9	2,88	2,93	-5	0	-11	1Y	5,21	4,16	0,78	2,54	5,83
7*10	2,91	2,97	0	1	-13	Swap	USD	EUR	JPY	CHF	GBP
8*11	2,95	3,01	0	1	-17	2R	4,93	4,21	0,94	2,63	5,69
9*12	3,03	3,06	1	3	-14	3R	4,87	4,20	1,08	2,66	5,65
1*7	2,68	2,74	0	1	-7	4R	4,89	4,19	1,20	2,68	5,60
2*8	2,74	2,80	0	2	-9	5R	4,93	4,19	1,32	2,71	5,55
3*9	2,82	2,87	0	2	-9	7R	5,01	4,22	1,53	2,78	5,44
4*10	2,86	2,92	2	3	-12	10R	5,13	4,29	1,78	2,88	5,30
5*11	2,89	2,95	0	1	-15	Měny	29.3.07	1D	1T	1M	3M
6*12	2,96	3,02	-2	3	-9	EURCZK	28,06	0,02%	0,29%	-0,33%	1,97%
						EURUSD	1,3321	0,04%	-0,08%	1,03%	0,94%

Tržní data – středoevropské dluhopisy

výnos	ČR			Polsko				Maďarsko				Slovensko				
	1D	1T	3M	výnos	1D	1T	3M	výnos	1D	1T	3M	výnos	1D	1T	3M	
1	3,02	0	0	-39	4,61	2	15	-4	7,48	1	-3	-76	4,26	0	-41	-89
5	3,36	2	6	-12	5,03	2	6	1	7,27	2	-3	-49	4,15	6	-16	-46
10	3,80	-2	2	7	5,19	2	1	3	6,87	2	4	-48	4,39	0	-20	-12
15	4,21	-1	4	14	5,34	4	7	1	6,59	1	8	-65	4,45	0	-20	-9

Prognózy ČS – měny, sazby, výnosy

	Měnové kurzy vůči euru a dolaru*						3M úrokové sazby (v %)						10R dluhopisy (v %)					
	CZK	CZK*	USD	SKK	HUF	PLN	CZE	USA	EMU	SKK	HUN	POL	CZE	USA	EMU	SKK	HUN	POL
Spot	28,1	21,1	1,33	33,5	250	3,88	2,6	5,4	3,9	4,3	7,9	4,2	3,8	4,6	4,0	4,2	6,6	5,2
1M	27,7	20,8	1,33	33,0	257	3,90	2,6	5,2	3,7	4,7	8,2	4,3	3,8	4,7	3,9	4,5	6,8	5,3
3M	27,7	20,5	1,35	33,1	256	3,87	2,6	4,8	3,7	4,7	7,9	4,4	3,9	4,6	4,0	4,5	6,8	5,3
6M	27,6	19,7	1,40	33,2	255	3,83	2,9	4,8	3,7	4,6	7,6	4,4	4,1	4,8	4,1	4,6	6,4	5,1
1R	26,9	20,7	1,30	32,2	249	3,73	3,3	4,6	3,6	4,3	6,6	4,7	4,3	4,9	4,1	4,6	5,9	4,8

Prognózy ČS – sazby centrálních bank

	Klíčová sazba (%)	Nejbližší zasedání	Prognóza ČS (bp)	Očekávání trhu (bp)	Poslední změna (bp)	Nejbližší očekávaná změna (bp)
Česká republika	2,50	29.3.2007	0	-	+25 / IX-06	+25 / VII-07
USA	5,25	9.5.2007	0	0	+25 / VI-06	-25 / VI-07
Eurozóna	3,75	12.4.2007	0	-	+25 / III-07	-25 / I-08
Slovensko	4,50	27.4.2007	-25	-	-25 / III-07	-
Maďarsko	8,00	23.4.2007	0	-	+25 / X-06	-50 / 3Q-07
Polsko	4,00	25.4.2007	+25	-	-25 / II-06	-