

Devisenhandels- und Derivateumsätze von Banken in Deutschland in den Monaten April 2001, April 2004, April 2007 und April 2010

Bereinigte Ergebnisse (= ohne doppelt erfasste Geschäfte zwischen inländischen Berichtsinstituten)

Mrd US-Dollar (Nominalwerte *)

Art der Transaktion	Zusammensetzung nach Geschäftspartnern												Umsätze insgesamt				Umsätze im Tagesdurchschnitt **)			
	Berichtende Banken				andere Banken / Finanzinstitutionen				Kunden											
	2001	2004	2007	2010	2001	2004	2007	2010	2001	2004	2007	2010	2001	2004	2007	2010	2001	2004	2007	2010
Devisenhandelsumsätze																				
Kassageschäfte	374	499	343	428	85	159	88	141	40	60	35	33	499	718	466	602	26	36	25	30
Outright Termingeschäfte	168	156	337	29	23	37	48	108	29	42	45	25	220	235	430	162	12	12	23	8
Devisenswaps	779	1109	692	787	125	232	220	412	59	58	68	78	963	1399	980	1277	51	70	52	64
Währungsswaps	2	1	3	18	1	1	1	6	1	1	0	2	4	3	4	26	0	0	0	1
Devisenoptionen	36	35	23	61	12	14	15	21	4	6	9	22	53	55	47	104	3	3	2	5
Devisenhandelsumsätze insgesamt	1359	1800	1398	1323	246	443	372	688	133	167	157	160	1739	2410	1927	2171	92	121	102	108
<i>darunter: Umsätze mit dem Ausland</i>	<i>1181</i>	<i>1694</i>	<i>1252</i>	<i>1180</i>	<i>175</i>	<i>395</i>	<i>274</i>	<i>528</i>	<i>56</i>	<i>92</i>	<i>76</i>	<i>85</i>	<i>1411</i>	<i>2181</i>	<i>1602</i>	<i>1793</i>	<i>74</i>	<i>109</i>	<i>84</i>	<i>90</i>
Euro gegen US-Dollar	691	720	590	581	126	174	167	301	67	80	85	79	885	974	842	961	47	49	44	48
Euro gegen andere Währungen	153	259	249	228	43	79	63	146	29	39	51	44	224	377	364	419	12	19	19	21
US-Dollar gegen andere Währungen	495	748	525	487	73	174	137	226	31	38	17	31	599	960	679	745	32	48	36	37
Restliche Währungen	20	74	33	26	3	14	5	16	6	10	4	6	30	98	42	47	2	5	2	2
Umsätze in zinsbezogenen Derivaten (OTC)																				
Zinsswaps	998	416	999	496	363	189	189	118	46	12	16	17	1407	617	1204	631	74	31	63	32
Zinsoptionen	39	24	26	25	7	17	8	7	7	3	4	4	53	44	38	36	3	2	2	2
Forward Rate Agreements	259	118	235	252	55	75	234	46	12	1	4	4	326	194	473	302	17	10	25	15
zinsbezogene Derivate insgesamt	1296	558	1260	773	425	281	431	171	65	16	24	25	1786	855	1715	969	94	43	90	48
<i>darunter Umsätze mit dem Ausland</i>	<i>1047</i>	<i>477</i>	<i>1023</i>	<i>663</i>	<i>356</i>	<i>166</i>	<i>319</i>	<i>138</i>	<i>57</i>	<i>3</i>	<i>2</i>	<i>10</i>	<i>1461</i>	<i>646</i>	<i>1344</i>	<i>811</i>	<i>77</i>	<i>32</i>	<i>71</i>	<i>41</i>

*) Der Euro-Wechselkurs gegenüber dem US-Dollar belief sich im Monatsdurchschnitt im April 2001 auf 0,8920 US-Dollar, im April 2004 auf 1,1985 US-Dollar, im April 2007 auf 1,3516 US-Dollar und im April 2010 auf 1,3406 US-Dollar.

**) 2001 19 Arbeitstage, 2004 20 Arbeitstage, 2007 19 Arbeitstage, 2010 20 Arbeitstage.