

Trade Ideas

Skandinaviske Enskilda Banken AB, Copenhagen

8/16/2019 3:59:38 PM

Fixed Income anbefalinger, DKK & EUR

Anbefaling pr.

			Long / short	Total	
Udnyt DKK/EUR swapkurve krumning	05-Nov-18	Link	Open mid (bps)	14.3 / 11.5	2.8
Efterspørgslen efter DKK renterisiko presser lange DKK/EUR spreads ned. Til gengæld har svækkelsen af EURDKK spotkursen skabt spekulation om en dansk renteforhøjelse og presset kortere DKK/EUR- spænd ud, samtidig med at danske fixinger er faldet med udsigt til en høj sektorlikviditet i den kommende tid. Det har resulteret i en markant krumning af DKK/EUR kurven omkring 4-5 års punktet.			Current mid (bps)	10.7 / 9.9	0.8
			Change X BPV		3.8
			Carry (cents)		0.0
			P/L (cents)		0.0
Køb 2ere vs 1,5 50 - rebalanceret	06-May-19	Link	Open mid (clean)	103.4 / 99.5	3.95
Efter det markante rentefald er 1,5'50 købt tilbage, hvorfor positionen er outright lang i 2'ere vs repo			Current mid (clean)	102.6 / 101.6	1.03
			Carry (cents)		61.3
			P/L (cents)		-143.5

Research

Trade Ideas



Skandinaviska Enskilda Banken AB, Copenhagen

Lukkede anbefalinger

	Handelside	Dato	Lukning	Dato	PnL
Modtag 5Y DKK swap (vs 6M) vs betal DKK OIS	Link	19-Feb-18	Link	24/05/2019	9.5
Betal 1Y1Y Eonia	Link	28-Mar-19	Link	24/05/2019	-5.3
Omlæg flexer swappet og refofinansieret til 5Y bostad	Link	02-Oct-17	Link	26-Apr-19	100.0
Lang DGB vs DBR	Link	20-Aug-18	Link	20-Dec-18	10.0
Stejlere EUR swap kurve gør 2Y1Y attraktiv	Link	16-Jan-18	Link	29-May-18	19.1
Modtag 5Y DKK/EUR swap (vs 3M) og short DGB 27 vs Bunds	Link	27-Sep-17	Link	07-May-18	45.9
Modtag 2-3Y Cita/Eonia – spændet	Link	25-Aug-17	Link	07-May-18	6.5
Modtag 5Y DKK/EUR swap (vs 3M)	Link	15-Sep-17	Link	24-Apr-18	23.8
Lang DBR vs DGB 25	Link	18-Jul-17	Link	06-Mar-18	-15.5
Betal 1-2Y Eonia outright	Link	06-Sep-17	Link	15-Jan-18	6.1
DGB 21/39 vs 25 barbell	Link	08-Jun-17	Link	18-Jul-17	35.0

