

EDGE

a SIX Telekurs display

Treasuryguide Edge 3.4

Innehållsförteckning

Välkommen till Edge Treasury	2
Öppna en sida	2
Allmänt	3
Instrumentsökning (Search...)	3
Yieldkurvor	4
Givare	4
Givarförkortningar	5
Treasurysidor	6
Treasury SE Bonds	6
Treasury FX MM	6
Treasury IRD	6
Nationella differenser	7
Norge	7
Finland	7
Prime Rates	7
CD	7

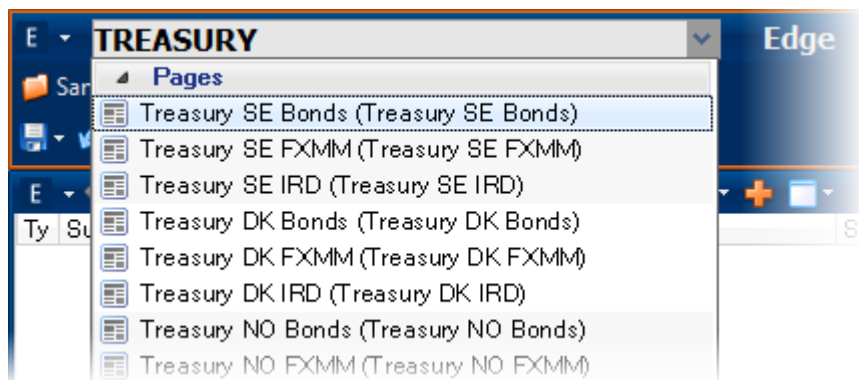
Välkommen till Edge Treasury!

Denna guide riktar sig till dig som är intresserad av att lära dig mer av treasuryinnehållet i Edge. Här presenteras de färdiga treasurysidor som finns tillgängliga i Edge, men även hur du kan anpassa vyerna och hämta in mer data till att passa dina specifika önskemål. Har du frågor om detta dokument eller om du är intresserad av att boka in en utbildning, är du välkommen att kontakta SIX Telekurs Customer Services. Kontaktuppgifterna finns längst ned på varje sida.

Öppna en sida

Klicka i fältet högst upp till vänster där namnet på din nuvarande aktiva sida står.

Skriv **Treasury** för att direkt få upp en lista över tillgängliga sidor med Treasury-data. Tryck **[Enter]** när du valt en viss sida för att öppna denna. Det går även utmärkt att skriva hela namnet på sidan för att direkt öppna upp denna. Skriv exempelvis **Treasury SE Bonds** följt av **[Enter]** för att öppna upp nämnd sida.



Allmänt

Det här avsnittet behandlar ett antal användbara funktioner som krävs för att användaren skall kunna utnyttja den kapacitet som Edge Treasury erbjuder.

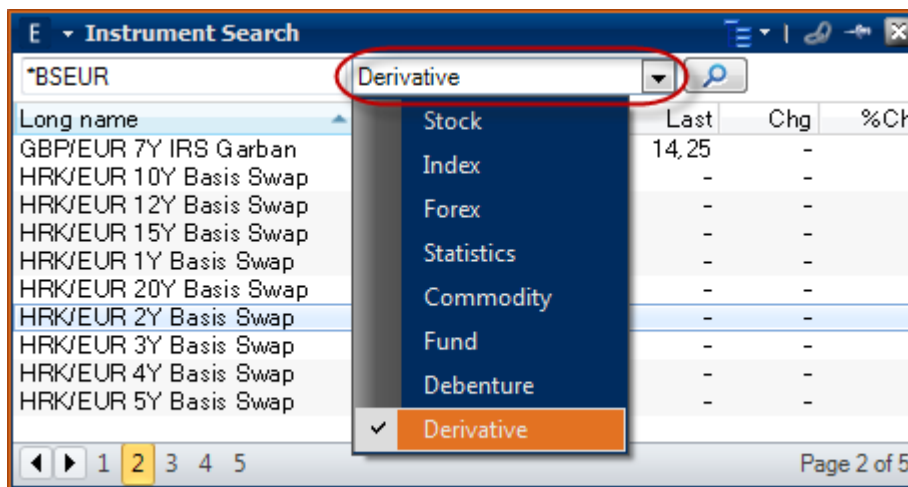
Instrumentsökning (Search...)

I detta sökfält kan du söka på alla instrument tillgängliga i databasen för Edge. Du kan söka på ticker, namn, ISIN eller olika förkortningar.

Genom att skriva * i början av ett ord, söker du på alla instrument där sökt ord på något sätt ingår i namnsträngen. Om vi exempelvis önskar söka upp **Basis Swap EUR**, kan vi med fördel skriva ***BSEUR**.




Efter att den initiala sökningen gjorts kan man även behöva specificera vilka variabler som är intressanta att filtrera ut. I ovanstående fall med ***BSEUR** får vi initialt inga träffar. Men genom att bocka för **Derivative** filtrerar vi ut samtliga derivat med ***BSEUR** i namnet, enligt bild nedan.



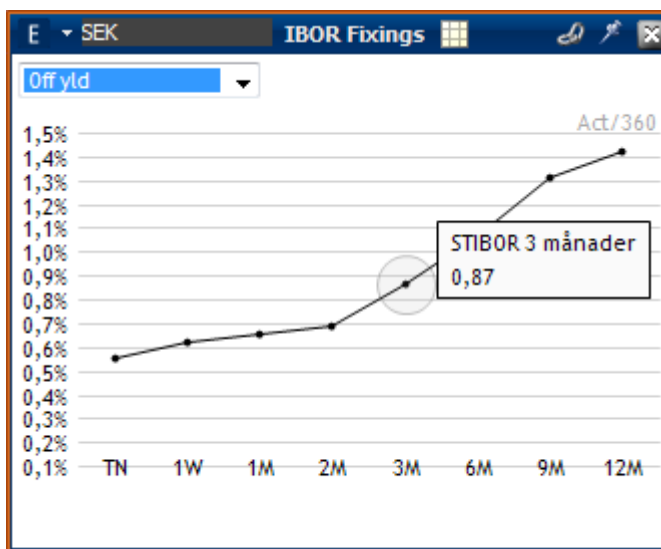
Efter att sökvariabler valts påbörjar man sökningen genom att klicka på -ikonen.

Yieldkurvor

Obligationer, Ränteswaps, Deposits samt **IBOR Fixings** kan illustreras både i tabellform samt grafiskt i form av en yieldkurva. Klicka på -ikonen för att rita upp vald information som en yieldkurva. (I dagsläget visar Edge inte yieldkurvor som nollkupongare).

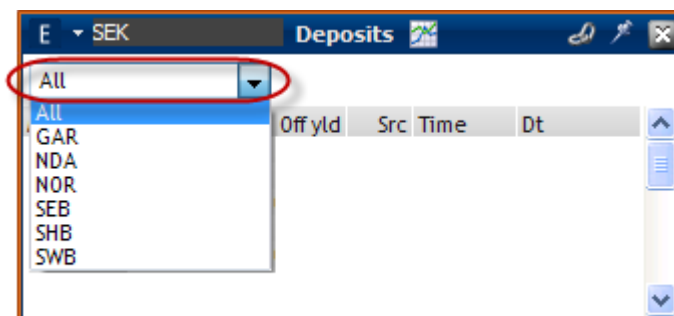


Bilden nedan visar en vald yieldkurva för **STIBOR Fixing**, där tre månaders **STIBOR** markerats.



Givare

Det finns ett antal givare av data i Edge Treasury. Det går att filtrera data genom att, i enlighet med nedanstående bild, välja en specifik givare av information.



Se sid 5 för vidare information gällande vilka institutioner som står bakom vilka givarförkortningar.

Givarförkortningar***General**

OMF – OMX Fixing
GTI – GTIS, Global Trading IS

Benchmark Bonds

TTL – Tullet / Prebon

Interest Rate Swaps / TN Swaps

CON – Consensus / Den Danske Bank
GAR – Garban
DDB – Den Danske Bank
HBM – Handelsbanken Market
NDA – Nordea
SEB – Skandinaviska Enskilda Banken
SES – SEB Stockholm
SWB – Swedbank
PHO – Pohjola Bank plc
BRX – Barclays Bank
RBG – Royal Bank of Scotland Group

Deposits

GAR – ICAP/Garban
NDA – Nordea
NOR – Nordea
SEB – Skandinaviska Enskilda Banken
SHB – Handelsbanken
SWB – Swedbank

Mortgage Bonds

CAIO – Handelsbanken Hypotek
LFBO – Länsförsäkringar Bolån
LFHY – Länsförsäkring Hypotek
NBHO – Nordea Hypotek
SBAO – Sveriges Bostadsfinansierings AB
SCBO – Sveriges Säkerställda Obligationer / SBAB
SEBB – SEB Bolån
SPIO – Spintab Hypotek (Swedbank)

Currencies

DDB – Den Danske Bank
DNO – DNB Nor
GTI – GTIS, Global Trading IS
HBM – Handelsbanken Markets
NDA – Nordea
SES – SEB Stockholm

*Vänligen notera att givare samt deras förkortningar förändras kontinuerligt. Ovanstående kan därför skilja sig från den aktuella versionen av Edge.

Treasurysidor

Treasury SE Bonds

Denna sida ger dig snabb tillgång till ett överskådligt perspektiv av obligationsmarknaden och dess största aktörer – staten samt bolåneinstituten. Se nedan för förklaring av aktuella flikar.

More Bonds	Kommun-, bostads-, samt indexlänkade obligationer
Interest Rate Forwards	Räntederivat
Interest Rate Swap	Ränteswaps
Reference Rates	Referensräntor
Treasury Bonds	Statsobligationer
Treasury Bills	Statsskuldsväxlar
Benchmark Bonds	Benchmarkobligationer

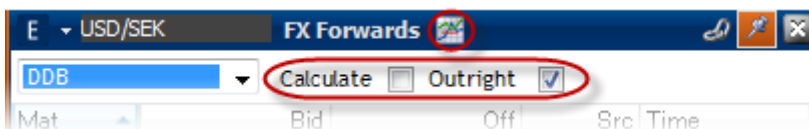
Under **Interest Rate Forwards** hamnar även olika stadsobligationer (**T-Bond**), Forward Rate Agreements (**FRA**) samt övriga räntederivat såsom riksbanksfutures (**RIBA**).

Treasury FX MM

Denna sida erbjuder ett överskådligt perspektiv över kort och långa och långa räntederivat samt valuta forwards.

Interest Rate Swaps	Ränteswap
Deposit	Depositlån
TN Swaps	Tomorrow – Next Ränteswap
IBOR Fixing	Interbank Offered Rate Fixing
IMM FRA	International Monetary Market Forward Rate Agreement
FX Forward	Valutaforward

I **FX Forward** är det även möjligt att räkna ut teoretiska valutaforward där givare saknas via funktionen **Calculate** , samt beräkna bid och offer i form av punkter eller i reell värdeförändring via alternativet **Outright** .



Treasury IRD

Denna sida fokuserar på de olika räntederivaten i Edge. Utöver informationen som även finns tillgänglig via Treasury FX MM, finns här även en överskådlig vy över **Swaptions** samt **Caps & Floors**. Via dessa vyer är det möjligt att **se Strike, ATM, Maturity** samt **Tenor**.

Nationella differenser

Norge

I Norge tillkommer en komplett obligationslista (**Bond List**) som kan filtreras på specifika givare. Denna lista finns tillgängligt i samtliga norska Treasurysidor.

pn	Bid	Ask	Last	Chg	B yld	A yld	Last yld	Chg yld	Vol
59	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Finland

Prime Rates samt **CD's** (Certificate of Deposit) finns tillgängliga i samtliga Finska Treasurysidor.

Prime Rates

Long name	Value
FIM Prime	1,3500
S-Prime	1,5000
Handelsbanken Prime	1,5000
OP-Prime	1,5500
SEB Gyllenberg Prime	1,7500

CD

Mat	Bid yld	Off yld	Src Time	Dt
M01	0,6400	0,5900	NDA 11:38:26	2010-07-2
M02	0,7200	0,6700	NDA 11:45:12	2010-07-2
M03	0,9000	0,8500	NDA 11:45:18	2010-07-2
M04	0,9600	0,9100	NDA 11:45:23	2010-07-2
M05	1,0500	1,0000	NDA 11:45:34	2010-07-2
M06	1,1400	1,0900	NDA 11:41:14	2010-07-2