

## Informationsdokument

# Swestr

Samlad information om Sveriges riksbanks  
ramverk för Swestr

mars 2024

# Innehållsförteckning

1	Riksbanken som administratör av Swestr	3
1.1	Swestr	3
1.2	Principiella bestämmelser	3
1.3	Styrningsarrangemang	4
1.4	Organisation	4
1.5	Transparens	5
1.6	Utvärdering och uppföljning	6
2	Metodologi för att fastställa Swestr	7
2.1	Underliggande marknad	7
2.2	Transaktionsunderlag	7
2.3	Databearbetning	8
2.4	Krav på robusthet	8
2.5	Beräkning	9
2.6	Fastställande av korrigerad Swestr	10
2.7	Kontinuitet	11
2.8	Specialregler vid årsskiftet	11
3	Metodologi för att fastställa genomsnittsräntor och index	12
3.1	Utformning och användning	12
3.2	Beräkningsmetod och marknadskonventioner	12
3.3	Avrundning	13
3.4	Fastställande av korrigerade genomsnittsräntor och index	14
4	Publicering	15
4.1	Publiceringsverktyg	15
4.2	Publiceringstidpunkter	15
4.3	Publiceringsformat	16
4.4	Värdedag	16
4.5	Förutsättningar för användning och vidarepublicering	16
5	Frågor, synpunkter och klagomål	17
5.1	Frågor och synpunkter	17
5.2	Klagomål	17
5.3	Rapportering av eventuella missförhållanden	17
6	Revisionshistorik för dokumentet	18

# 1 Riksbanken som administratör av Swestr

1 kap. 12 § lagen (2022:1568) om Sveriges riksbank slår fast att Riksbanken får tillhandahålla och offentliggöra sådana referensvärden som avses i Benchmarkförordningen.<sup>1</sup>

## 1.1 Swestr

Sveriges Riksbank fastställer, tillhandahåller och kontrollerar referensräntan Swedish krona Short Term Rate (Swestr). Detta innebär att Riksbanken är administratör för Swestr.

Swestr är en referensränta för den kortaste löptiden som beräknas av Riksbanken på grundval av transaktioner som genomförs i svenska kronor från den aktuella bankdagen till nästa, overnight (O/N), och som rapporteras in till Riksbanken av stora aktörer på penningmarknaden. Transaktionerna sker mellan rapportören och banker, Riksgäldskontoret, finansiella institut eller icke-finansiella företag. Swestr är en fullt ut transaktionsbaserad referensränta på den kortaste löptiden i svenska kronor och är således ett sådant referensvärde som avses i Benchmarkförordningen.

Riksbanken tillhandahåller även genomsnittsräntor för tidsperioder på 1 vecka, 1 månad, 2 månader, 3 månader och 6 månader som baseras på de fastställda noteringarna för Swestr, och är följaktligen administratör även för dessa genomsnittsräntor. Riksbanken tar även fram ett index baserat på Swestr-noteringarna.

Riksbanken publicerar Swestr och genomsnittsräntor samt index varje bankdag.

Swestr kan bland annat användas som ett riktmärke, eller basvärde, vid prissättning av finansiella kontrakt, såsom räntederivat, valutaderivat och räntebärande värdepapper. Swestr kan även användas vid prissättning av lån med rörlig ränta.

Om inget annat uttryckligen framgår ska begreppet Swestr i detta informationsdokument referera till såväl Swestr som genomsnittsräntor och index baserade på Swestr.

## 1.2 Principiella bestämmelser

I likhet med andra centralbanker som tillhandahåller referensräntor följer Riksbanken i tillämpliga och relevanta delar de principer för finansiella referensvärden som antagits av den Internationella organisationen för värdepapperstillsyn (Iosco).<sup>2</sup> Iosco-principerna togs fram för att främja tillförlitligheten för referensräntor och för att

---

<sup>1</sup> Med Benchmarkförordningen avses Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 av den 8 juni 2016 om index som används som referensvärden för finansiella instrument och finansiella avtal eller för att mäta investeringsfonders resultat, och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2014/17/EU och förordning (EU) nr 596/2014.

<sup>2</sup> Principles for Financial Benchmarks, Iosco, juli 2013.

bidra till god styrning, kontroll, transparens och kvalitet i fastställandet av referensräntor. Principerna anger vilka arrangemang en administratör bör ha på plats och utgör internationell standard för hur en administratör ska bedriva arbetet med referensräntor.

Swestr beräknas utifrån transaktioner som är representativa för dagslånemarknaden i svenska kronor. Denna marknad, som är en likvid och konkurrensutsatt marknad som uppfyller tillämpliga losco-principer för referensräntor, utgör således den underliggande marknaden för Swestr.

I enlighet med losco-principerna kommer Swestr vara föremål för regelbunden utvärdering. Denna utvärdering kommer innefatta den underliggande marknaden samt huruvida beräkningsmetoden på ett bra sätt speglar aktiviteten på denna marknad. Även processen för fastställande och publicering kommer att vara föremål för regelbunden översyn.

Swestr bör även vara väl förankrad bland de marknadsaktörer som använder referensräntan och Riksbanken har därför inrättat Rådgivande grupp för Swestr. Denna grupp kan även bidra till att underlätta Riksbankens informationsinhämtning för uppföljning av Swestr.<sup>3</sup>

## 1.3 Styrningsarrangemang

Riksbanken tillser god intern styrning och kontroll för Swestr genom:

- ett robust internt regelverk, inklusive erforderliga styrdokument för Swestr, med tydliga roller och ansvarsområden,
- väl dokumenterade interna rutinbeskrivningar avseende processen för att fastställa och publicera Swestr,
- etablerade processer för att identifiera och hantera intressekonflikter kopplade till Swestr, samt
- att det bedrivs ett aktivt och systematiskt riskförebyggande arbete, inklusive kontinuitetsplanering.

## 1.4 Organisation

### 1.4.1 Direktionen

Riksbankens direktion fattar principiellt viktiga beslut angående Swestr, såsom om övergripande organisation samt om grundläggande bestämmelser för processen för att fastställa och publicera Swestr. Direktionen beslutar även om utformningen av Swestr samt av genomsnittsräntor och index.

---

<sup>3</sup> Läs mer om Rådgivande grupp för Swestr på Riksbankens webbplats.

#### **1.4.2 Avdelningen för marknader**

Avdelningen för marknader (AFM) har det övergripande ansvaret för att operationalisera Riksbankens roll som administratör.

#### **1.4.3 Avdelningen för penningpolitik**

Statistikenheten på Avdelningen för penningpolitik (APP) genomför den process som varje bankdag tillämpas för att fastställa och publicera Swestr.

#### **1.4.4 Avdelningen för finansiell stabilitet**

Avdelningen för finansiell stabilitet (AFS) ansvarar för Riksbankens interna övervakning av Swestr.

Övervakningen bedrivs i en kommitté som består av medlemmar från olika delar av Riksbankens organisation. Övervakningskommittén följer upp och övervakar efterlevnaden av samtliga på Swestr tillämpliga losco-principer.

#### **1.4.5 Avdelningen för IT och digitalisering**

Avdelningen för IT och digitalisering (AID) ansvarar, tillsammans med Riksbankens IT-driftleverantör, för utveckling, underhåll och drift av systemstödet för Swestr.

### **1.5 Transparens**

Riksbanken tillämpar bland annat följande åtgärder för att uppnå så stor transparens som möjligt vad gäller Swestr.

#### **Metodologi och styrdokument**

Riksbanken publicerar information om metodologi och aktuella processer på Riksbankens webbplats och offentliggör relevanta styrdokument.

#### **Swestr, genomsnittsräntor och index**

Riksbanken publicerar noteringar för Swestr, genomsnittsräntor och index på Riksbankens webbplats varje svensk bankdag. Vidare publiceras övergripande information om det aktuella transaktionsunderlaget. I övrigt kommenterar Riksbanken inte de dagliga noteringarna för Swestr.

#### **Rapport om transaktionsunderlag för Swestr**

I denna rapport publicerar Riksbanken kvartalsvis och med eftersläpning information om hur eventuella förändringar av transaktionsunderlaget, som i efterhand kommit till Riksbankens kännedom, hade påverkat Swestr-noteringarna om förändringarna varit kända när respektive Swestr-notering fastställdes. Rapporten är av sammanfattande karaktär och innefattar dagar då absolutvärdet av påverkan på Swestr överstiger 0,001 procentenheter (0,1 baspunkter).

Rapporten innehåller även sammanfattande information om transaktionsunderlagets sammansättning. Fördelningen per olika typer av motparter till rapportörerna samt per de underliggande transaktionernas storlek redovisas. Denna typ av information redovisas första gången i den rapport som avser första kalenderkvartalet 2023.

### **Årsrapport för Swestr**

Riksbanken kommer framöver även att publicera en årsrapport för Swestr. Den första rapporten kommer att avse kalenderåret 2023.

## **1.6 Utvärdering och uppföljning**

I enlighet med losco-principerna kommer Riksbanken att utvärdera och följa upp utformningen av Swestr och Riksbankens arbete i övrigt avseende Swestr.

Riksbanken intygar årligen att Riksbanken i tillämpliga och relevanta delar lever upp till losco-principerna genom att publicera ett uttalande om Swestr's regelefterlevnad, s.k. årligt intygande (statement of compliance).

## 2 Metodologi för att fastställa Swestr

### 2.1 Underliggande marknad

Den underliggande marknaden för Swestr utgörs av dagslånemarknaden i svenska kronor.

### 2.2 Transaktionsunderlag

#### Datakälla för Swestr

Datakälla för Swestr är den dagliga rapporteringen av korta penningmarknadstransaktioner som Riksbankens penningpolitiska motparter är ålagda att göra.<sup>4</sup> I dagsläget är det transaktioner från nio banker som används för Swestr.

Mer information om rapporteringen finns i de instruktioner som Riksbanken tillhandahåller för detta syfte. Rapporteringsinstruktionerna finns publicerade på Riksbankens webbplats.

#### Dagräkningskonvention

Transaktioner rapporteras med dagräkningskonvention faktiskt antal dagar genom 360.

#### Aktuella transaktioner

De transaktioner som utgör grund för Swestr är de som:

- har genomförts i svenska kronor,
- har en volym om åtminstone 10 MSEK,
- har löptid over-night (O/N), dvs. från transaktionsdagen till nästkommande bankdag,
- leder till icke-säkerställd inlåning hos den rapporterade penningpolitiska motparten,
- görs med en motpart ur någon av följande kategorier:
  - banker och finansiella institut (S122-S129),
  - icke-finansiella företag (S11) eller
  - Riksgäldskontoret.

Koncerninterna transaktioner ingår inte i transaktionsunderlaget.<sup>5</sup>

---

<sup>4</sup> Riksbankens penningpolitiska motparter är de aktörer som har tillgång till Riksbankens penningpolitiska instrument. Mer information om Riksbankens penningpolitiska motparter finns på Riksbankens webbplats.

<sup>5</sup> Begreppen koncern (*eng. group*) och koncerninterna transaktioner (*eng. intra-group transactions*) definieras i enlighet med förordning ECB/2014/48.

Uppdelningen i motpartskategorier följer standarden i European System of Accounts (ESA2010). Klassificeringen baseras på information om s.k. Legal Entity Identifier (LEI-kod) som den penningpolitiska motparten ska tillhandahålla.<sup>6</sup>

## 2.3 Databearbetning

### Kontroller och validering

För att säkerställa kvaliteten i de inrapporterade data som ligger till grund för beräkningen av Swestr tillämpar Riksbanken automatiserade kontroller som syftar till att identifiera transaktioner som kan misstänkas vara oavsiktligt och/eller avsiktligt felrapporterade. I de fall där de automatiska kontrollerna identifierar en transaktion som potentiellt felrapporterad används den i beräkningen av Swestr om och endast om rapportören bekräftar ("validerar") att den är korrekt rapporterad.

## 2.4 Krav på robusthet

För att transaktionsunderlaget ska anses vara tillräckligt robust ska:

- transaktionsunderlaget uppgå till minst 6 mdr SEK,
- minst tre rapportörer rapporterat transaktioner, samt
- en enskild rapportör inte stå för mer än 75 % av den totala transaktionsvolymen.

Robusthetskraven avser transaktionsunderlaget innan trimning.

Normal beräkningsmetod används om transaktionsunderlaget anses vara tillräckligt robust. Om något av robusthetskraven inte är uppfyllt eller om transaktionsunderlaget inte är tillgängligt, exempelvis p.g.a. tekniskt fel, beräknas Swestr med alternativ beräkningsmetod.

---

<sup>6</sup>Om den penningpolitiska motparten inte kan uppge LEI-kod för motparten så ska istället en sektorkod enligt ESA2010 uppges av rapportören. I dessa fall klassificeras transaktionen enligt sektorkoden.



## 2.5 Beräkning

### 2.5.1 Trimning

Innan beräkning av Swestr trimmar Riksbanken transaktionsunderlaget för att minska påverkan från extremvärden.<sup>7</sup>

Totalt 25 procent av transaktionsvolymen exkluderas från fortsatta beräkningar:

- 12,5 procent av transaktionsvolymen med de lägsta räntorna
- 12,5 procent av transaktionsvolymen med de högsta räntorna

Swestr beräknas alltså utifrån de mittersta 75 procenten av transaktionsvolymen.

### 2.5.2 Normal beräkningsmetod

Med normal beräkningsmetod avses ett volymviktat genomsnitt av räntorna i det trimmade dataunderlaget.

Swestr med värdedag  $i$  beräknas enligt följande formel:

$$Swestr_i = \sum_{k=1}^{N_i} \frac{v_k}{V_i} r_k$$

där:

$k$  = ett index som representerar varje transaktion i det trimmade transaktionsunderlaget för värdedag  $i$

$N_i$  = antalet transaktioner i det trimmade transaktionsunderlaget för värdedag  $i$

$r_k$  = ränta för transaktion  $k$

$v_k$  = volym för transaktion  $k$

$V_i$  = total transaktionsvolym i det trimmade underlaget för värdedag  $i$

### 2.5.3 Alternativa beräkningsmetoder

Beroende på den aktuella situationen finns två alternativa beräkningsmetoder.

#### Tekniskt fel

Om det aktuella transaktionsunderlaget inte är tillgängligt, exempelvis vid tekniskt fel, används följande formel för alternativ beräkning av Swestr med värdedag  $i$ :

$$Swestr_i = R_i + \frac{1}{2} \sum_{k=1}^2 (Swestr_{i-k} - R_{i-k})$$

där:

$k$  = ett index som representerar varje värdedag för Swestr tillika bankdag

$Swestr_{i-k}$  = fastställd Swestr-notering för värdedag  $i - k$

$R_i$  = Riksbankens styrränta för bankdag  $i$

<sup>7</sup> Med trimning avses att symmetriska andelar av den totala transaktionsvolymen exkluderas från transaktionsunderlaget innan beräkning. Transaktionerna ordnas enligt sina respektive räntenivåer, varefter 12,5 procent av transaktionsvolymen med de lägsta räntorna samt 12,5 procent med de högsta räntorna exkluderas från fortsatta beräkningar.

### Transaktionsunderlaget uppfyller inte samtliga robusthetskrav

Om det aktuella transaktionsunderlaget är tillgängligt, men inte uppfyller samtliga krav på robusthet, används följande formel för beräkning av Swestr med värdedag  $i$ :

$$Swestr_i = R_i + \frac{1}{3} \sum_{k=0}^2 (Swestr_{i-k} - R_{i-k})$$

där:

$k$  = ett index som representerar varje värdedag för Swestr tillika bankdag

$$Swestr_{i-k} = \begin{cases} Swestr_{i-k} \text{ beräknad enligt normal beräkningsmetod,} & \text{om } k = 0 \\ \text{fastställd Swestr-notering för värdedag } i - k, & \text{om } k > 0 \end{cases}$$

$R_i$  = Riksbankens styrränta för bankdag  $i$

#### 2.5.4 Beräkningstidpunkter<sup>8</sup>

Beräkning inför ordinarie publicering av Swestr sker kl. 8:30.

Beräkning inför en eventuell publicering av korrigerad Swestr sker 11:30.

#### 2.5.5 Avrundning

Eventuell avrundning sker så sent som möjligt och följer etablerade matematiska principer för avrundning.<sup>9</sup>

#### 2.5.6 Rimlighetsbedömning

Som en försiktighetsåtgärd görs en rimlighetsbedömning innan ett beräknat värde för Swestr fastställs och publiceras. Om ett beräknat värde är uppenbart orimligt sett till det aktuella transaktionsunderlaget fastställs Swestr med den alternativa beräkningsmetod som normalt används ifall transaktionsunderlaget är otillgängligt.

## 2.6 Fastställande av korrigerad Swestr

Vid fall att transaktionsdata inkommit och/eller validerats efter det första beräkningstillfället kan Riksbanken fastställa en korrigerad notering för Swestr. En korrigerad notering kan även fastställas efter tidigare tekniskt fel.

En korrigerad notering för Swestr kommer att fastställas om, och endast om, absolutvärdet av skillnaden mellan tidigare fastställt värde och beräknat värde vid andra beräkningstillfället överstiger 0,02 procentenheter (2 baspunkter).

En korrigerad notering ersätter den tidigare noteringen som fastställt värde för Swestr den aktuella dagen.

<sup>8</sup> Dessa tidpunkter gäller från och med Swestr-noteringen med värdedag 28 april 2023. Dessförinnan gäller kl. 10:00 respektive kl. 13:00.

<sup>9</sup> Med etablerade matematiska principer avses avrundning bort från noll, det vill säga 0,0055 avrundas till 0,006 och -0,0055 avrundas till -0,006.

Vid fall att en korrigerad Swestr-notering har fastställts kommer detta att framgå på Riksbankens webbplats.<sup>10</sup> Noteringen uppdateras även i det API som tillhandahålls för Swestr, se avsnitt 4.

Efter publiceringstidpunkt för korrigerad Swestr kommer inget nytt värde för Swestr att fastställas, oaktat ny eller förändrad transaktionsdata.

## 2.7 Kontinuitet

Riksbanken har utförliga kontinuitetsrutiner avseende Swestr och eftersträvar att alltid kunna publicera Swestr i enlighet med bestämmelserna i avsnitt 4. I ett kontinuitetsläge kommer Riksbanken i första hand att tillämpa alternativ beräkningsmetod för Swestr enligt avsnitt 2.4 och/eller att publicera Swestr med reservrutiner, se avsnitt 4.

Om Riksbanken trots detta inte har publicerat en notering för Swestr senast kl. 12:00 på publiceringsdagen gäller nedanstående bestämmelser för användare av Swestr.<sup>11</sup>

Som Swestr-notering tillämpas ett värde motsvarande genomsnittet av de två närmaste föregående bankdagarnas Swestr-noteringar, justerat för eventuella förändringar i Riksbankens styrränta. Värdet avrundas till tre decimaler i enlighet med etablerade matematiska principer.

Detta motsvarar det värde som skulle ha fastställts för Swestr med alternativ beräkningsmetod vid tekniskt fel.

## 2.8 Specialregler vid årsskiftet

Riksbanken tillämpar inga specialregler för beräkningen av Swestr vid årsskiftet.

De statistiska konfigurationerna för Riksbankens automatiska kontroller, som syftar till att identifiera potentiellt felrapporterade transaktioner, kan däremot komma att kalibreras så att transaktioner den sista bankdagen på året inte påverkar utfall av framtida kontroller.

---

<sup>10</sup> Informationen om noteringen uppdateras automatiskt på huvudsidan för Swestr och publiceringstidpunkten för noteringen ändras till kl. 12:00. Denna tidpunkt gäller från och med Swestr-noteringen med värdedag 28 april 2023. Dessförinnan gäller kl. 14:00.

<sup>11</sup> Denna tidpunkt gäller från och med Swestr-noteringen med värdedag 28 april 2023. Dessförinnan gäller kl. 14:00.

## 3 Metodologi för att fastställa genomsnittsräntor och index

### 3.1 Utformning och användning

Riksbanken tillhandahåller bakåtblickande genomsnittsräntor och ett index baserade på de fastställda noteringarna för Swestr. Genomsnittsräntorna och indexet är kumulativa och speglar en löpande förräntning med Swestr. Genomsnittet och indexet är således av den typ som brukar benämnas som *cumulative compounded (average rate)* och möjliggör bland annat användning av s.k. *observation shift*.

Genomsnittsräntor baserade på Swestr tillhandahålls för tidsperioderna 1 vecka samt 1, 2, 3 och 6 månader. Genomsnittsräntan för en enskild tidsperiod tillhandahålls endast om startdagen för perioden infaller 1 september 2021 eller senare.

Index tillhandahålls eftersom det medger enkel beräkning av genomsnittsränta för Swestr under en period mellan två valfria bankdagar.

### 3.2 Beräkningsmetod och marknadskonventioner

#### 3.2.1 Dagräkningskonvention

Beräkningskonventionen om att året har 360 dagar tillämpas för beräkning av genomsnittsräntor och index.

#### 3.2.2 Genomsnittsräntor

Perioderna för genomsnittsräntorna bestäms bakåtblickande med utgångspunkt i periodens slutdatum tillika publiceringsdatumet för genomsnittsräntan.

Den dag som inleder den period som en genomsnittsränta beräknas över benämns som periodens startdag,  $t = 0$ . Enligt marknadskonvention beräknas ränta från och med periodens startdag till dess slutdag.

I det fall beräknad startdag inte är en bankdag ska:

- för tidsperioden 1 vecka tillämpas justeringsprincipen (*standard*) *preceding business day*, dvs. startdagen tidigareläggs till närmast föregående bankdag,
- för övriga tidsperioder tillämpas justeringsprincipen *modified preceding business day*, dvs. startdagen tidigareläggs till närmast föregående bankdag så länge detta inte innebär att startdagen hamnar i en annan månad, i vilket fall startdagen istället senareläggs.

Genomsnittsräntan med värdedag  $i$  beräknas med följande formel:

$$\text{Genomsnittsränta}_i = \left[ \prod_{t=1}^i \left( 1 + \frac{r_t \times n_t}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d_c}$$

där:

$t$  = ett index som representerar varje bankdag i perioden som inleds med  $t = 0$  och avslutas med värdedag  $i$

$r_t$  = Swestr-notering som publiceras på bankdag  $t$ , dvs.  $r_t = \text{Swestr}_{t-1}$

$n_t$  = antal kalenderdagar som ränta  $r_t$  är applicerbar för

$d_c$  = antal kalenderdagar i ränteperioden

$n_t$  är generellt sett 1, förutom för måndagar då det är 3 för att ta hänsyn till förräntning över helgen, eller där justering behövs för att ta hänsyn till vardagar som inte är bankdagar

### 3.2.3 Index

Index för Swestr med värdedag  $i$  beräknas med följande formel:

$$\text{Index}_i = \begin{cases} 100, & \text{om } i = 0 \\ 100 \times \prod_{t=1}^i \left( 1 + \frac{r_t \times n_t}{360} \right), & \text{om } i > 0 \end{cases}$$

där:

$t$  = ett index som representerar varje bankdag sedan  $t = 0$

$r_t$  = Swestr-notering som publiceras på bankdag  $t$ , dvs.  $r_t = \text{Swestr}_{t-1}$

$n_t$  = antal kalenderdagar som ränta  $r_t$  är applicerbar för

$t = 0$  avser 1 september 2021

$n_t$  är generellt sett 1, förutom för måndagar då det är 3 för att ta hänsyn till förräntning över helgen, eller där justering behövs för att ta hänsyn till vardagar som inte är bankdagar

### 3.2.4 Överensstämmelse mellan index och genomsnittsräntor

Genomsnittsränta för en period från och med valfri bankdag  $x$  till valfri bankdag  $y$ , kan beräknas med hjälp av indexnoteringar:

$$\left( \frac{\text{Index}_y}{\text{Index}_x} - 1 \right) \times \frac{360}{d_c}$$

där:

$d_c$  = antal kalenderdagar i ränteperioden, dvs.  $y - x$

$\text{Index}_i$  = Swestr-index med värdedag  $i$

## 3.3 Avrundning

Eventuell avrundning sker så sent som möjligt inför publicering och följer etablerade matematiska principer för avrundning.<sup>12</sup>

<sup>12</sup> Med etablerade matematiska principer avses avrundning bort från noll, det vill säga 0,0055 avrundas till 0,006 och -0,0055 avrundas till -0,006.

### 3.4 Fastställande av korrigerade genomsnittsräntor och index

Korrigerade värden för genomsnittsräntor och index fastställs om, och endast om, en korrigerad notering för Swestr fastställts eller fel i beräkningen upptäckts. Dessa korrigerade noteringar ersätter i så fall de tidigare som fastställda noteringar.

## 4 Publicering

### 4.1 Publiceringsverktyg

#### **API**

Den officiella publiceringen av Swestr samt publiceringen av genomsnittsräntor och index baserade på Swestr utgörs av publiceringen i de applikationsprogrammeringsgränssnitt (*application programming interface, API*) som Riksbanken tillhandahåller för dessa syften.

#### **Riksbankens webbplats**

Informationen publiceras även på Riksbankens webbplats. Riksbankens webbplats utgör alternativ publiceringskanal vid fall reservrutiner behöver tillämpas för publicering.

Skulle varken Riksbankens API eller Riksbankens webbplats inte fungera kommer publiceringen ske via GlobeNewsWire.

### 4.2 Publiceringstidpunkter

#### **Swestr<sup>13</sup>**

Swestr publiceras varje svensk bankdag kl. 9:00.

En eventuellt korrigerad notering för Swestr publiceras kl. 12:00.

#### **Genomsnittsräntor och index<sup>14</sup>**

Genomsnittsräntor och index baserade på Swestr publiceras varje svensk bankdag kl. 9:05.

Eventuellt korrigerade noteringar för genomsnittsräntor och index publiceras kl. 12:05.

---

<sup>13</sup> Tidpunkterna gäller från och med Swestr-noteringen med värdedag 28 april 2023. Dessförinnan gäller kl. 11:00 respektive kl. 14:00.

<sup>14</sup> Tidpunkterna gäller från och med noteringarna för genomsnittsräntor och index med värdedag 2 maj 2023. Dessförinnan gäller kl. 11:05 respektive kl. 14:05.

## 4.3 Publiceringsformat

Swestr publiceras i procentform med tre decimaler. Utöver räntenoteringen publiceras följande information om transaktionsunderlaget:<sup>15</sup>

- total volym (MSEK),
- antal transaktioner,
- antal rapportörer som rapporterat transaktioner,
- räntenivån vid den övre trimningsgränsen, tillika räntenivån vid 87,5 percentilen av transaktionsvolymen (procentform med två decimaler), samt
- räntenivån vid den nedre trimningsgränsen, tillika räntenivån vid 12,5 percentilen av transaktionsvolymen (procentform med två decimaler).

Den publicerade informationen avser transaktionsunderlaget före trimning.

Vid en korrigerad notering för Swestr publiceras även korrigerad information om transaktionsunderlaget.

Genomsnittsräntor för Swestr publiceras i procentform med fem decimaler. För varje genomsnittsränta publiceras även startdagen för den tidsperiod som räntan avser.

Index för Swestr publiceras i decimalform med åtta decimaler. Startdatumet (1 september 2021) har indexvärde 100.

## 4.4 Värdedag

### **Swestr**

Swestr har värdedag den dag som de underliggande transaktionerna har genomförts och avvecklats. Swestr publiceras med en bankdags eftersläpning.

### **Genomsnittsräntor och index**

Genomsnittsräntor och index har värdedag samma dag som publiceringsdagen, och inkluderar informationen i den Swestr-notering som publiceras samma dag.

## 4.5 Förutsättningar för användning och vidarepublicering

Förutsättningar för användning och för vidarepublicering av Swestr, inklusive genomsnittsräntor och index publiceras på Riksbankens webbplats på svenska och engelska.

---

<sup>15</sup> Räntenivåerna vid trimningsgränserna publiceras dagligen från och med Swestr-noteringen med värdedag 31 maj 2023. I nära anslutning till att denna notering publiceras kommer även information om motsvarande räntenivåer för samtliga redan publicerade Swestr-noteringar att presenteras.



## 5 Frågor, synpunkter och klagomål

### 5.1 Frågor och synpunkter

Frågor och synpunkter avseende Swestr kan skickas till [swestr@riksbank.se](mailto:swestr@riksbank.se).

### 5.2 Klagomål

Riksbanken tillhandahåller en formell kanal för klagomål rörande Swestr. Klagomål kan skickas genom antingen fysiskt brev eller e-post.

#### **Fysiskt brev**

Sveriges Riksbank  
103 37 Stockholm  
Ange "Klagomål Swestr" i brevet

#### **E-post**

Använd e-postadressen [swestr.klagomal@riksbank.se](mailto:swestr.klagomal@riksbank.se)  
Ange "Klagomål Swestr" i ämnesraden

#### **Hantering av klagomål**

Riksbanken hanterar inkomna klagomål i enlighet med gällande lagstiftning och Riksbankens interna regelverk. Det innebär bland annat att medarbetare som är föremål för klagomålet inte kommer vara delaktig i processen för hantering av klagomål.

### 5.3 Rapportering av eventuella missförhållanden

Riksbanken tillhandahåller en intern rapporteringskanal för visselblåsning. Genom denna kanal kan Riksbankens medarbetare anonymt anmäla eventuella missförhållanden, exempelvis vad gäller Swestr.

## 6 Revisionshistorik för dokumentet

**Tabell 1. Revisionshistorik**

Revideringar av Swestr: *Samlad information om Sveriges Riksbanks ramverk för Swestr*

Publiceringsdatum	Diarie-nummer	Revideringar
2021-06-22	2021-00767	Ursprunglig version av dokumentet.
2021-10-01	2021-00767	Förtydliganden avseende minsta transaktionsvolym, beräkningstidpunkter, fastställande av korrigerade noteringar, kontinuitetsrutiner, publicerad information om transaktionsunderlaget samt startdag för genomsnittsräntor. Tillägg av information om rimlighetsbedömning samt vad som ska ske om Riksbanken ej lyckas publicera Swestr. Redaktionella ändringar för att tillse att dokumentet återger tydlig och korrekt information.
2022-06-08	2022-00722	Redaktionella ändringar till följd av att Avdelningen för IT och digitalisering har inrättats samt att Riksbankens reporänta byter namn till Riksbankens styrränta. Revisionshistorik tillagd.
2023-01-02	2022-00722	Revidering till följd av den årliga granskningen av styrande dokument. Hänvisningar till lagen (2022:1568) om Sveriges riksbank har lagts till. Formler har förtydligats och information om klassificering av motparter samt om koncerninterna transaktioner har lagts till, men inga ändringar i sak har gjorts. I övrigt har endast mindre redaktionella ändringar gjorts.
2023-03-31	2023-00457	Revidering till följd av organisationsförändringar på Riksbanken gällande arbetet med Swestr, att publiceringstidpunkterna tidigare läggs samt att den information som tillhandahålls om transaktionsunderlaget för Swestr utökas.
2024-03-27	2024-00483	Kontinuitetsrutin för publicering av Swestr: Skulle varken Riksbankens API eller Riksbankens webbplats inte fungera kommer publiceringen ske via GlobeNewsWire.



**SVERIGES RIKSBANK**

Tel 08 - 787 00 00

[registratorn@riksbank.se](mailto:registratorn@riksbank.se)

[www.riksbank.se](http://www.riksbank.se)

PRODUKTION SVERIGES RIKSBANK)

ISSN ISSN. (online)