

Rapport om transaktionsunderlag för Swestr

Tertial 3 2021 (2021-09-01 – 2021-12-31)
Publicerad 2022-02-07

Report on the transaction dataset for SWESTR

*1 September 2021 – 31 December 2021
Published 7 February 2022*

Riksbanken strävar efter så stor transparens som möjligt avseende Swestr. Därför tillhandahåller Riksbanken sammanfattande information om hur förändringar av transaktionsunderlaget som skett i efterhand skulle ha påverkat de fastställda Swestr-noteringarna.

The Riksbank aims to be as transparent as possible regarding SWESTR. Therefore, the Riksbank provides summary information about how subsequent changes to the transaction dataset would have affected the determined SWESTR values.

Om rapporten

Riksbanken strävar efter så stor transparens som möjligt avseende Swestr. Av denna anledning publicerar Riksbanken information om hur förändringar, som i efterhand har skett med transaktionsunderlaget för Swestr, skulle ha påverkat Swestr-noteringarna om de varit kända när Swestr fastställdes. Rapporten publiceras med eftersläpning och täcker i normalfallet in ett kalenderkvartal. Denna första rapport täcker dock in det tredje tertialet 2021.

Denna rapport inkluderar de tillfällen där transaktionsunderlaget har förändrats mellan de första och andra beräkningstillfällena, exempelvis på grund av sen rapportering eller validering, men där förändringen inte varit stor nog för att Riksbanken skulle fastställa en korrigerad Swestr-notering. Rapporten inkluderar även de tillfällen där transaktionsunderlaget har förändrats efter andra beräkningstillfället, exempelvis på grund av att en rapportör har justerat inrapporterad data i efterhand. Även förändringar i transaktionsunderlaget på grund av fel hos Riksbanken framgår i rapporten.

Rapporten inkluderar samtliga tillfällen där absolutvärdet av skillnaden mellan den fastställda Swestr-noteringen och det värde som beräknas baserat på det förändrade transaktionsunderlaget överstiger 0,1 räntepunkter (dvs. 0,001 procentenhet). För

varje tillfälle som rapporten tar upp anges sammanfattande information om varför transaktionsunderlaget förändrats. En eller flera av följande tre orsaker till förändrat transaktionsunderlag anges således för varje tillfälle:

- **Sen rapportering eller validering**
En eller flera rapportörer har inte rapporterat eller validerat transaktionsdata i tid. Alla förändringar mottagna samma dag som SWESTR-noteringen publicerades hänförs till denna kategori.
- **Förändrad data i efterhand**
En eller flera rapportörer har i efterhand rapporterat förändrad transaktionsdata. Alla förändringar mottagna efter den dag som SWESTR-noteringen publicerades hänförs till denna kategori.
- **Administratörsfel**
Ett operationellt fel hos Riksbanken eller ett fel i Riksbankens system har påverkat beräkningen.

Rapporten har avstämningsdag för transaktionsunderlaget vid utgången av den första månaden som följer på den period som rapporten avser, och publiceras fem bankdagar efter avstämningsdagen.

Tabell 1. Absolutpåverkan på Swestr

Table 1. Absolute impact on SWESTR

Räntepunkter
Basis points

#	Värde dag	<0,1 - 0,5 ≤	<0,5 - 1,0 ≤	<1,0 - 2,0 ≤	2,0 <	Anledning
#	Value date	<0.1 - 0.5 ≤	<0.5 - 1.0 ≤	<1.0 - 2.0 ≤	2.0 <	Reason
1	2021-09-01	✓				Förändrad data i efterhand <i>Subsequently changed data</i>
2	2021-09-02	✓				Förändrad data i efterhand <i>Subsequently changed data</i>
3	2021-09-03	✓				Förändrad data i efterhand; Administratörsfel <i>Subsequently changed data; Administrator error</i>
4	2021-09-06	✓				Förändrad data i efterhand; Administratörsfel <i>Subsequently changed data; Administrator error</i>
5	2021-09-07	✓				Förändrad data i efterhand; Administratörsfel <i>Subsequently changed data; Administrator error</i>
6	2021-09-08	✓				Förändrad data i efterhand; Administratörsfel <i>Subsequently changed data; Administrator error</i>
7	2021-09-09	✓				Förändrad data i efterhand; Administratörsfel <i>Subsequently changed data; Administrator error</i>
8	2021-10-04	✓				Sen rapportering eller validering <i>Late reporting or validation</i>
9	2021-10-18	✓				Sen rapportering eller validering <i>Late reporting or validation</i>
10	2021-11-22	✓				Sen rapportering eller validering; Förändrad data i efterhand <i>Late reporting or validation; Subsequently changed data</i>

#	Värdedag	<0,1 - 0,5 ≤	<0,5 - 1,0 ≤	<1,0 - 2,0 ≤	2,0 <	Anledning
11	2021-12-07	✓				Administratörsfel Administrator error
12	2021-12-08	✓				Administratörsfel Administrator error
13	2021-12-09	✓				Administratörsfel Administrator error
14	2021-12-10	✓				Administratörsfel Administrator error
15	2021-12-30				✓	Administratörsfel Administrator error

Absolutpåverkan på Swestr i räntepunkter (1 räntepunkt = 0,01 procentenheter). Avstämningsdag för transaktionsunderlaget är 2022-01-31. Datum anges på format ÅÅÅÅ-MM-DD. Absolutpåverkan 2021-12-30 var 3,8 räntepunkter.

Absolute impact on SWESTR in basis points (1 basis point = 0.01 percentage points). Reconciliation date for the transaction dataset is 2022-01-31. Dates are in format YYYY-MM-DD. The absolute impact on 30 December 2021 was 3.8 basis points.

About the report

The Riksbank aims to be as transparent as possible regarding SWESTR. Hence, the Riksbank publishes information on how subsequent changes to the transaction dataset for SWESTR would have affected SWESTR values, if they had been known when SWESTR was determined. The report is published with a delay and normally covers a calendar quarter. This first report, however, covers the period 1 September 2021 – 31 December 2021.

This report includes instances when changes have occurred to the transaction dataset between the first and the second calculation, e.g. due to late reporting or validation, but the changes were not large enough for the Riksbank to determine a corrected SWESTR value. The report also includes instances when changes occurred to the transaction dataset after the second calculation, e.g. due to a reporting agency subsequently changing the reported data. Changes to the transaction dataset due to errors by the Riksbank also appear in the report.

The report includes all instances where the absolute difference between the determined SWESTR value and the value calculated based on the changed transaction dataset exceeds 0.1 basis point (i.e. 0.001 percentage points). For each instance included in the report, summary information about the reasons for the changes to the transaction dataset is provided. One or more of the following three reasons for a changed transaction dataset are thus provided for each instance:

- **Late reporting or validation**

One or more reporting agencies did not report or validate transaction data by the deadline. All changes received on the publication day of the SWESTR value are attributed to this category.

- **Subsequently changed data**
One or more reporting agencies have subsequently reported changed transaction data. All changes received after publication day of the SWESTR value are attributed to this category.
- **Administrator error**
An operational error at the Riksbank or an error in the Riksbank's systems has affected the calculation.

The data in the report is reconciled on the last day of the month following the period covered by the report. The report is published five banking days after the day of reconciliation.