

Rapporteringsinstruktioner

**Årlig rapportering av  
penningmarknadsdata**

2023-11-23

DNR 2023-00454

# 1. Bakgrund

Riksbanken samlar in data om transaktioner på penningmarknaden. Syftet med Riksbankens insamling av aktuell data är att analysera den korta penningmarknaden i svenska kronor (SEK) och för att utvärdera genomförandet av penningpolitiken. En del av den data som samlas in dagligen utgör även underlag för beräkning av referensräntan Swestr (Swedish krona Short Term Rate).

Rapporterinstruktioner uppdateras regelbundet. Den senaste versionen finns på Riksbankens webbplats. Rapportörer bör alltid säkerställa att de använder den senaste versionen.

Frågor om Rapporteringsinstruktionernas innehåll samt rapportering av transaktioner på penningmarknaden till Riksbanken hänvisas till [tora@riksbank.se](mailto:tora@riksbank.se).

## 2. Allmänna krav

### 2.1 Närmare anvisningar om skyldigheter för rapportörer

I Villkor för RIX och penningpolitiska instrument (Villkoren) finns det dels generella krav för alla motparter (B.3.2.1), dels separata krav för RIX-deltagare (B.3.2.2) resp. penningpolitiska motparter (B.3.2.3) respektive Motpart med tillgång till Särskilda Faciliteter för Centrala Motparter (B.3.2.5).

Enligt avsnitt B.3.2.3 (c) Särskilda krav för Penningpolitiska Motparter i Villkoren ska Penningpolitiska Motparter:

” ..enligt Riksbankens närmare anvisningar, rapportera till Riksbanken dels hur stor omsättning den Penningpolitiska Motparten och dess koncernbolag haft på penning- och obligationsmarknaden, dels information om transaktioner på penningmarknaden. Riksbanken kan avstå från denna rapportering eller del därav om Institutet enligt Riksbankens bedömning har en liten betydelse som aktör på marknaden.”

Enligt avsnitt B.3.2.5 (c) Särskilda krav för Motpart med tillgång till Särskilda Faciliteter för Centrala Motparter i Villkoren ska Penningpolitiska Motparter:

” .. enligt Riksbankens närmare anvisningar, rapportera till Riksbanken information om transaktioner på penningmarknaden.”

Ifall Riksbanken anser att den penningpolitiska motparten har en liten betydelse som aktör på den relevanta marknaden kan Riksbanken avstå från den dagliga rapporteringen till förmån av en årlig rapportering. Rapporteringskravet uppfylls då genom rapportering enligt dessa anvisningar.

Riksbankens utgångspunkt är att den dagliga rapporteringen ska ge ett brett och representativt underlag av den underliggande marknaden. En penningpolitisk motpart

som exkluderas från den dagliga rapportering kan alltså anses ha liten betydelse ifall underlaget som Riksbanken samlar in inte påverkas betydelsefullt.

Som huvudregel väljs aktörerna i aktivitetsordning, från mest aktiva till minst aktiva, in till den dagliga rapporteringen ända tills täckningen av marknaderna är tillräcklig.

Ytterligare rapportörer kan därefter anses ha liten betydelse som aktör på marknaden om de inte påverkar underlaget betydelsefullt. Denna huvudregel kan frångås, t.ex. om en aktör är särskilt viktig i något segment, fyller en särskild funktion i marknaden eller sysslar med annan verksamhet som är nära knuten till penningmarknaden. Rapportörer som inte behöver rapportera dagligen ska då istället rapportera årligen.

## 2.2 Rapporteringens omfattning

Årlig rapportering innebär att motparterna en gång per år ska rapportera in information om de transaktioner de genomfört på penningmarknaden under föregående år, i aggregerat format.

Rapporteringen ska omfatta alla de transaktioner enligt definitionen i avsnitt 2.3 som är denominerade i SEK och som har bokförts i enheter inom EU/EES.

Relevant rapporteringsnivå för rapporteringen är den penningpolitiska motparten (juridisk person).

Koncerninterna transaktioner ska inte rapporteras. "Grupp" (group) och "koncerninterna transaktioner" (intra-group transactions) definieras i artikel 1.15 och 1.19 i förordning ECB/2014/48.

## 2.3 Penningmarknadens segment

Rapportörer (som utgör en juridisk person) ska till Riksbanken rapportera data om transaktioner denominerade i SEK med en ursprunglig löptid av högst tio dagar (definierat som transaktioner med en löptid av högst tio dagar från likviddagen) inom **tre segment:**

- a) **Segmentet för transaktioner med säkerhet:** Återköpsavtal inklusive repor och omvända repor, sell/buy-backs samt buy/sell-backs (in- eller utlåning).
- b) **Segmentet för transaktioner utan säkerhet:**
  - i. Transaktioner som omfattar mottagen inlåning (deposits), annan inlåning utan säkerhet samt emission av korta skuldinstrument
  - ii. Transaktioner som omfattar placerade insättningar (deposits), annan utlåning utan säkerhet samt köp av korta skuldinstrument på förstahandsmarknader

Det är enbart avtalad inlåning med fast löptid, uppsägningstid eller andra begränsningar på uttag som ska rapporteras. Inlåning utan någon form av

restriktioner eller begränsningar, löpande konton osv. ska inte rapporteras.

- c) **Valutaswappar:** Transaktioner där svenska kronor (SEK) säljs/köps mot en utländsk valuta med ett avtal att reversera försäljningen/köpet vid ett i förväg överenskommet framtida datum.

### 2.3.1 Relevanta motparter och definitioner

Som huvudregel ska transaktioner mellan rapportören och följande motparter rapporteras: finansiella bolag, offentlig sektor, utländska centralbanker och icke-finansiella bolag. Både transaktioner med inhemska och utländska motparter ska rapporteras.

## 2.4 Rapporteringsdetaljer

Det relevanta Excel-arket som ska användas vid den årliga rapporteringen finns under relaterat innehåll på Riksbankens hemsida under Statistik/Swestr/För rapportörer.

Inrapporterad volym ska rundas av till närmaste heltal och formateras som nummer i Excel-arket, det ska således inte finnas formler eller referenser till andra Excel-ark i den sammanställningen som är Riksbanken tillhanda.

Om det inte finns några transaktioner att rapportera inom ett segment ska fältet lämnas blankt eller rapporteras som noll.

Vidare instruktioner finns i Excel-arket som ska användas vid årlig rapportering och relevanta definitioner finns i "Rapporteringsinstruktioner – daglig rapportering av penningmarknadsdata".

## 2.5 Rapporteringsfrist

Den årliga rapporten ska skickas till [tora@riksbank.se](mailto:tora@riksbank.se) senast 40 bankdagar efter årsskiftet.

## 3. Kontaktuppgifter

Frågor relaterade till rapporteringen hänvisas till [tora@riksbank.se](mailto:tora@riksbank.se)



**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)