

Rapporteringsinstruktioner

**Daglig rapportering av
penningmarknadsdata**

2024-01-30

DNR 2023-00454

Version 1.8 av Rapporteringsinstruktioner – daglig rapportering av penningmarknadsdata publiceras 2023-11-23 och träder ikraft samma dag.

| Version | Datum | Beskrivning |
|----------------|--------------|---|
| 1.9 | 2024-01-30 | Förtydligande i sektion 2.4 Penningmarknadens segment i punkt b), ii. "Återköp av emmittenten betraktas inte som transaktion på förstahandsmarknad." |
| 1.8 | 2023-11-22 | Ändring i sektion 2.1 Rapporteringskrav införs för "Motpart med tillgång till Särskilda Faciliteter för Centrala Motparter". |
| 1.7 | 2023-11-21 | Förtydligande om krav på närbarhet i <i>Sektion 2.2 Närmare anvisningar om skyldigheter för rapportörer</i> : "Samt att någon av de ansvariga personerna hos det rapporterande institutet ska var nära." |
| 1.6 | 2023-03-31 | Nytt namn på dokument: <i>Rapporteringsinstruktioner– daglig rapportering av penningmarknadsdata.</i> I sektionerna 3.3.1.1 <i>Definition av variabler – segmentet för transaktioner med säkerhet</i> har förtydligande angående variabeln "DEAL RATE" gjorts. Sektion 2.5.1 Rapporteringsfrister har uppdaterats för ny daglig rutin i produktion av Swestr (Ex. förhållningstider för rapportörer att hantera valideringskontroller). <i>Appendix 3: Daglig rutin för rapportering av de transaktioner som ligger till grund för Swestr</i> korrigerad efter ändringar i rutinen. |
| 1.5 | | Ny sektion 2.1 <i>Rapporteringskrav för penningpolitiska motparter</i> . Avsnittet beskriver vilka som behöver rapportera dagligen till Riksbanken enligt dessa anvisningar. Delar av gamla sektion 2.1 har flyttats till sektion 2.2 <i>Närmare anvisningar om skyldigheter för rapportörer</i> . <i>Appendix 3: Daglig rutin för rapportering av de transaktioner som ligger till grund för Swestr</i> korrigerad efter ändringar i rutinen. |
| 1.4 | | Nya krav på rapportörerna angående skyldigheter gällande informationsutlämning till Riksbanken har tillkommit i sektion 2.1 <i>Krav på rapporteringen och närmare anvisningar om skyldigheter för rapportörer</i> . Delvis till följd av ändringar av kraven på operativ förmåga att agera som penningpolitisk |

| | | |
|-----|------------|--|
| | | <p>motpart som träder i kraft den 1 januari 2021 efter remissbehandling under hösten 2020.</p> <p>Instruktioner för daglig rutin för rapportering av de transaktioner som ligger till grund för Riksbankens nya referensränta har lagts till i sektion 2.4.1 <i>Rapporteringsfrister</i> och Appendix 3.</p> <p>I sektion 2.4.2 <i>Ändringar och rättelser av tidigare rapporterade transaktioner</i> har ett förtydligande om hur och när rapportering enligt "NOVATION" ska användas.</p> <p>I sektion 2.4.4 <i>Sen rapportering av transaktioner</i> har förtydliganden angående sen rapportering lagts till.</p> <p>I sektionerna 3.3.1.1 <i>Definition av variabler – segmentet för transaktioner med säkerhet</i> och 3.3.2.1 <i>Definition av variabler – segmentet för transaktioner utan säkerhet</i> och 3.3.3.1 <i>Definition av variabler – valutaswappar</i> har kraven på viss information ändrats från att tidigare varit valfri till att vara obligatoriska i de fall informationen finns tillgänglig. I segmentet för säkerställda transaktioner har en ändring skett gällande BROKERED DEAL som tidigare varit valfri men som nu ska rapporteras.</p> <p>Därtill finns några mindre korrigeringar.</p> |
| 1.3 | 2019-11-27 | Rapporteringsundantaget för små och medelstora företags transaktioner togs bort. Ändrad kodlista för referensvärden. Tillfälligt klargörande i fråga om rapporteringsfrister. Korrigerad versionshistorik. |
| 1.2 | 2019-06-24 | Ränteberäkningskonventionen korrigerades |
| 1.1 | 2019-06-20 | Förtydliganden om rapportören. En möjlighet infördes att i nuläget inte rapportera mindre transaktioner. Sektorskoder för MIS 2014:1 ersattes med ENS 2010. Mindre korrigeringar. |
| 1 | 2019-05-21 | |

Innehållsförteckning

| | | |
|----------|--|----|
| 1 | Sammanfattning/förord/inledning | 5 |
| 2 | Allmänna krav | 6 |
| 2.1 | Rapporteringskrav för penningpolitiska motparter respektive motparter med tillgång till särskilda faciliteter för centrala motparter | 6 |
| 2.2 | Närmare instruktioner om skyldigheter för rapportörer | 7 |
| 2.3 | Rapporteringens omfattning | 8 |
| 2.4 | Penningmarknadens segment | 8 |
| 2.4.1 | Relevanta motparter och definitioner | 8 |
| 2.5 | Rapporteringsfrister, ändringar och felrapportering | 9 |
| 2.5.1 | Rapporteringsfrister | 9 |
| 2.5.2 | Ändringar och rättelser av tidigare rapporterade transaktioner | 9 |
| 2.5.3 | Rapportering på transaktionsfria dagar | 10 |
| 2.5.4 | Sen rapportering av transaktioner | 10 |
| 3 | Rapporteringsstruktur | 10 |
| 3.1 | Business Application Header | 12 |
| 3.2 | Reporting Header | 13 |
| 3.3 | Reporting message | 14 |
| 3.3.1 | Segmentet för transaktioner med säkerheter | 14 |
| 3.3.1.1. | Definition av variabler – segmentet för transaktioner med säkerheter | 16 |
| 3.3.1.2. | Variabelkoder – segmentet för transaktioner med säkerheter | 20 |
| 3.3.2 | Segmentet för transaktioner utan säkerheter | 24 |
| 3.3.2.1. | Definition av variabler – segmentet för transaktioner utan säkerhet | 24 |
| 3.3.2.2. | Variabelkoder – segmentet för transaktioner utan säkerhet | 28 |
| 3.3.3 | Valutaswappar | 31 |
| 3.3.3.1. | Definition av variabler – valutaswappar | 31 |
| 3.3.3.2. | Variablekoder – valutaswappar | 34 |
| | Appendix 1 – Kodlista | 37 |
| | Appendix 2 – Kodlista för referensvärden utan ISIN-kod | 40 |
| | Appendix 3 – Daglig rutin för rapportering av de transaktioner som ligger till grund för Swestr | 41 |

1 Sammanfattning/förord/inledning

Riksbanken samlar in data om transaktioner på penningmarknaden. Detta ger Riksbanken bättre underlag för utvärderingen av hur Riksbankens penningpolitik genomförs. Genom insamlingen av data får Riksbanken också en bättre insikt i den svenska penningmarknaden.

Användarhandledningen uppdateras regelbundet. Den senaste versionen kommer att finnas på Riksbankens webbplats. Rapportörer bör alltid säkerställa att de använder den senaste versionen.

Frågor om användarhandledningens innehåll samt rapportering av transaktioner på penningmarknaden till Riksbanken kan skickas till tora@riksbank.se

2 Allmänna krav

2.1 Rapporteringskrav för penningpolitiska motparter respektive motparter med tillgång till särskilda faciliteter för centrala motparter

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), 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 inte anser att någon av ovannämnda motparter har en liten betydelse som aktör på den relevanta marknaden uppfylls detta rapporteringskrav genom rapportering enligt dessa instruktioner. Om en rapportör istället anses ha en liten betydelse som aktör på marknaden kan Riksbanken avstå från den dagliga rapporteringen till förmån av en årlig rapportering.

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 samlas 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 Närmare instruktioner om skyldigheter för rapportörer

En Penningpolitisk Motpart ska ha operativ förmåga att agera som sådan. Enligt Villkorens lydelse från 1 januari 2021 (avsnitt B.3.2.3):

”Ett Institut ska, utöver vad som följer av B.3.2.1, för att godtas som Penningpolitisk Motpart vara deltagare i RIX, ha säte eller filial i Sverige, ha operativ förmåga att agera som Penningpolitisk Motpart. Detta krav inkluderar, men är inte begränsat till, att ha nödvändiga och säkra system, nödvändig kompetens, relevant intern kontroll, dokumenterade och testade rutiner för både normala tider och kontinuitetssituationer, vad gäller alla aktiviteter som penningpolitisk motpart.”

och (Bilaga H9 till Villkoren, Anvisningar Motpartsansökan. Första stycket i avsnitt C.5.6):

”En Penningpolitisk Motpart ska ha operativ förmåga att agera som detta. Detta innebär bl.a. att man har nödvändiga och säkra system, nödvändig kompetens, relevant intern kontroll, dokumenterade och testade rutiner för både normala tider och kontinuitetssituationer. Detta gäller alla aktiviteter som penningpolitisk motpart.”

Nedan beskrivna krav på rapportörer till TORA utgår ifrån de villkoren som trädde i kraft den 1 januari 2021.

Enligt avsnitt B.3.2.9 i Villkoren ska en penningpolitisk motpart (hädanefter Motpart) uppfylla kraven enligt Villkoren under hela den tid som Institutet är Motpart. Därför bör Rapportören regelbundet, minst en gång om året, säkerställa att kraven i Användarhandledningen uppfylls.

Enligt avsnitt B.3.2.1(f)(iv) i Villkoren åtar sig en Motpart att delta i den uppföljning av Motparter som Riksbanken löpande gör och lämna den information som Riksbanken efterfrågar. Sådan uppföljning och efterfrågan på information kan även avse Riksbankens krav på rapportering och krav på Rapportörens interna hantering av rapporteringen.

Enligt avsnitt B.3.2.1(f) (vi) i Villkoren åtar sig en Motpart att följa de bestämmelser som gäller i verksamheten. I detta sammanhang kan sådana bestämmelser avse intern kontroll, rapporteringssystem för anmälningar om misstänkta överträdelser av bestämmelser. Motparten åtar sig också att ha en tydlig struktur för ansvarsfördelning för att undvika intressekonflikter. Rapportörer uppmuntras att upprätta interna rutiner för visseblåsning. Detta i syfte att möjliggöra för personal att anmäla betänkligheter angående bl.a. rapportering av transaktioner till Riksbanken.

Motparten ska ha en person som ansvarar för rapporteringen till Riksbanken samt för övriga frågor relaterade till Riksbankens rapporteringskrav. Detta inkluderar ansvar om att informationen uppfyller kraven i denna användarhandledning. Ansvarig person anges på blanketten ”Behörighetsanmälan för transaktionsrapporteringssystemet TORA”. Ansvarig person ska även säkerställa att de användaridentiteter som

tillhandahålls av Riksbanken endast är tillgängliga för personer som är behöriga att använda dessa identiteter. Samt att någon av de ansvariga personerna hos det rapporterande institutet ska vara nåbar.

2.3 Rapporteringens omfattning

I denna användarhandledning behandlas rapportering av data om transaktioner på penningmarknaden. Relevant rapporteringsnivå för rapporteringen är den penningpolitiska motparten (juridisk person).

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

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.

2.4 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. Återköp av emittenten betraktas inte som transaktion på förstahandsmarknad.
- 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.

2.4.1 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. LEI-kod (Legal Entity Identifier) bör om möjligt användas för att identifiera motparter. Om LEI-kod saknas måste sektor och geografisk belägenhet rapporteras. Om en utländsk

motpart saknar LEI-kod, ska sektorn rapporteras som om motparten var inhemsk. Är motparten t.ex. en utländsk bank ska sektorn rapporteras som S122 (Monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken) och relevant landskod.

Transaktioner med ett nominellt belopp under 10 miljoner SEK behöver inte rapporteras, men kan rapporteras tills vidare.

2.5 Rapporteringsfrister, ändringar och felrapportering

2.5.1 Rapporteringsfrister

Daglig rapportering avser alla bankdagar. Rapporterna ska lämnas till Sveriges Riksbank mellan kl. 16:30 – 20:00 samma bankdag och kl. 00:00 – 07:00 följande bankdag. Det innebär att en transaktion med trade date på en måndag ska rapporteras mellan kl. 16:30 – 20:00 på måndagen eller kl. 00:00 – 07:00 på tisdagen. Om tisdagen är en helgdag, blir rapporteringsfristen i stället kl. 7:00 på onsdagen.

Utöver daglig rapportering av transaktioner ska rapportörer även hantera transaktioner som har blivit flaggade i de olika valideringsstegen. Valideringsstegen består av en kontroll för avvikande värden och en kontroll för parmatchning. Tidsfrist att hantera båda valideringsstegen är kl. 08:15. Se "Appendix 3" för fullständig beskrivning av den dagliga rutinen för rapportering och validering av transaktioner som ligger till grund för Riksbankens referensränta.

2.5.2 Ändringar och rättelser av tidigare rapporterade transaktioner

Om fel upptäcks i tidigare rapporterade transaktioner måste de rättas så att de rapporterade transaktionerna alltid återspeglar de villkor och förutsättningar som faktiskt gäller. Om tidigare rapporterade transaktioner ändras ska ursprungligt transaktions-ID användas. Den här typen av ändringar kan normalt lämnas i samband med den vanliga dagliga rapporteringen. Ändringar klassificeras på följande sätt:

- Amendment (AMND): Fel/ändringar i tidigare rapporterade transaktioner som rapporteras på nytt på rapportörernas eget initiativ
- Correction (CORR): Fel som rättas på begäran av Riksbanken.
- Cancellation (CANC): Transaktioner som inte skulle ha rapporterats eller som annulleras av andra skäl.

Ändringar i t.ex. ränta eller löptid till följd av att tidigare rapporterade transaktioner har omförhandlats ska rapporteras som ny transaktion (NEWT).

Om möjligt ska en Novation (byte av motpart) rapporteras som ny transaktion och flaggas som novation (NOVA). Ursprungligt transaktions-ID ska rapporteras i fältet "RELATED PROPRIETARY TRANSACTION". Ifall bytet görs till en CCP (central motpart)

och den ursprungliga transaktionen inte har hunnit rapporteras kan transaktionen direkt rapporteras som en ny transaktion gjord med CCP:n.

2.5.3 Rapportering på transaktionsfria dagar

Även om det inte har genomförts några transaktioner inom ett visst segment, ska detta rapporteras. I så fall rapporteras inga värden men rapporteringsmeddelandet ska flaggas som "NOTX".

2.5.4 Sen rapportering av transaktioner

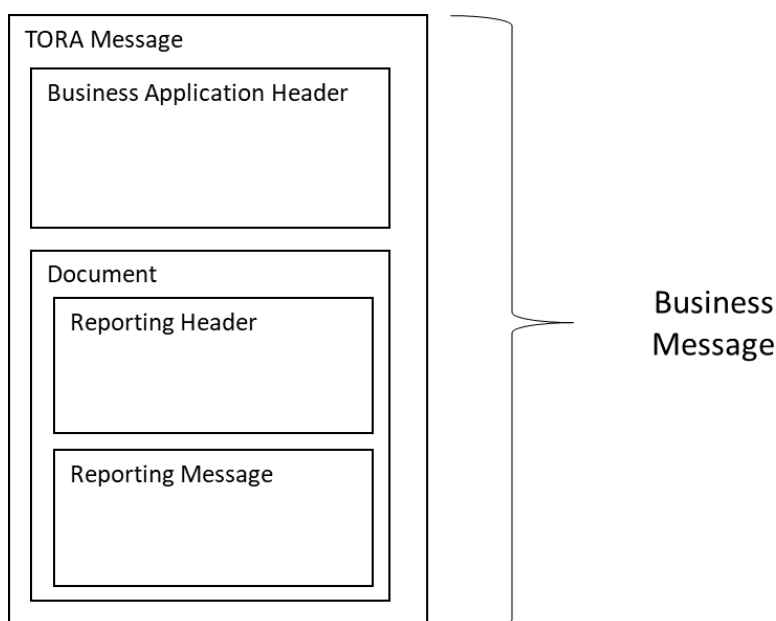
I de fall en eller flera transaktion(er) som skulle ha rapporterats för en specifik dag inte har rapporterats ska denna/dessa transaktion(er) rapporteras så snart som möjligt. Inga ändringar eller tillägg behöver göras i rapporteringen för denna/dessa transaktion(er) för att förtydliga att det är en sen rapportering. Däremot måste rapportören meddela Riksbanken via mail att sen rapportering inkommit. Rapportörer kan även på anmodan av Riksbanken bli ombedda att granska tidigare rapportering i syfte att säkerställa kvalitet vilket kan medföra att tidigare transaktioner korrigeras eller att tidigare transaktioner som ej rapporterats behöver rapporteras in i efterhand. Vid ett sådant tillfälle anger Riksbanken under vilka premisser sådan rapportering ska genomföras.

3 Rapporteringsstruktur

Det filformat som används består av två komponenter:

- a) Business Application Header (BAH)
- b) Ett dokument som består av två delar:
 - i) Reporting Header: Anger rapportör, referensperiod osv

ii) Reporting Message: Innehåller information om transaktionsdata



Ovanstående bild visar hur TORA-meddelandet är strukturerat.

- RB_TORA_validation_ReportingMessages.xsd
 - Detta är en technical wrapper med referens till Business Application Header och den inkommande rapporten (segmentet för transaktioner med säkerhet, segmentet för transaktioner utan säkerhet eller valutaswappar) eller det utgående statusmeddelandet
- head_001_001_01.xsd
 - Beskriver strukturen för BAH. Alla meddelanden måste ha en BAH.
 - Meddelandeformat för [Business Application Header V01 \(head.001.001.01\)](#)
- Auth_012_001_02.xsd
 - Meddelandeformat för [Money Market Secured Market Statistical Report V02 \(auth.012.001.02\)](#)
 - [Från ISO20022](#)
 - Beskriver formatet för transaktioner i segmentet för transaktioner med säkerhet
- Auth_013_001_02.xsd
 - Meddelandeformat för [Money Market Unsecured Market Statistical Report V02 \(auth.013.001.02\)](#)
 - [Från ISO20022](#)
 - Beskriver formatet för transaktioner i segmentet för transaktioner utan säkerhet
- Auth_014_001_02.xsd
 - Meddelandeformat för [Money Market Foreign Exchange Swaps Statistical Report V02 \(auth.014.001.02\)](#)
 - [Från ISO20022](#)
 - Beskriver formatet för transaktioner i segmentet för valutaswappar

- Auth_028_001_01.xsd
 - Meddelandeformat för [Money Market Statistical Report Status Advice V01 \(auth.028.001.01\)](#)
 - [Från ISO20022](#)
 - Används av Riksbanken för att sända information till rapportören om status för rapporterade transaktioner

3.1 Business Application Header

I nedanstående tabell beskrivs variablerna i Business Application Header

| Variabelnamn | Beskrivning |
|-----------------------------|--|
| Business Message Identifier | Teckensträng som ger en unik identifiering av meddelandet från rapportören. Systemet kommer att avvisa dubblett-ID:n från samma rapportör (LEI-kod) |
| Sender | Identifierar meddelandets avsändare genom rapportörernas LEI-kod Variabeln heter "FR" i TORA-meddelandets Application Header |
| Receiver | Identifierar meddelandets mottagare genom Riksbankens LEI-kod Variabeln heter "To" i TORA-meddelandets Application Header |
| Business Service | Anger vilken miljö som meddelandet dirigeras till. Denna variabel har två giltiga värden: RB_TORA_PROD och RB_TORA_TEST RB_TORA_PROD bör användas för all normal rapportering RB_TORA_TEST bör bara användas för testning |
| Market Segment Identifier | Anger vilket segment som dessa data avser: segmentet för transaktioner med säkerhet, segmentet för transaktioner utan säkerhet eller valutaswappar. Denna variabel heter "MsgDefldr" i TORA-meddelandets Application Header |
| Creation Date | Datum när filen genererades |

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|-----------------------------|--------|--------------|
| H10 | Business Message Identifier | Sträng | INTREF012345 |

| | | | |
|-----|---------------------------------|---|---|
| H20 | Sender | Sträng LEI [ISO17442] | |
| H30 | Receiver | Sträng LEI [ISO17442] | "549300VLYM2XZE4FJF95" avser Riksbanken |
| H40 | Business Service | Sträng Längd: 13 RB_TORA_PROD eller RB_TORA_TEST | RB_TORA_TEST |
| H50 | Market Segment Identifier | Sträng Längd: 15 CL_MARKET_SEGMENT (Se appendix 1) | auth.012.001.02 avser segmentet för transaktioner med säkerhet |
| H60 | Creation Date | Datum/tid enligt ISO- standard 20022 och ISO-standard 8601. YYYY-MM- DDThh:mm:ssZ | 2019-01-03T19:15:00Z |

3.2 Reporting Header

| | |
|------------------|--|
| Variabelnamn | Beskrivning |
| Reporting Agent | Rapportörens LEI-kod |
| Reference Period | Start- och slutdatum för relevant rapporteringsperiod |

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|---------------------|--|--|
| H70 | Reporting Agent | Sträng Maxlängd: 20 [ISO17442] | |
| H80 | Reference Period | Datum/tid [ISO 8601] ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss+/- hh:mm Information om tidszon ('+/- hh:mm') måste inkluderas | 2019-01- 03T19:00:00+01:00 2019-01- 04T19:00:00+01:00 |

3.3 Reporting message

Nedanstående tabell gäller för alla segment av penningmarknaden.

| Variabelnamn | Beskrivning |
|-----------------|---|
| Data Set Action | Anger meddelandets innehåll. Om rapportören inte har genomfört något relevant under den relevanta tidsperioden ska "NOTX" rapporteras. När transaktioner rapporteras inkluderas inte detta fält i meddelandet. |

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|-----------------|---|---------|
| D10 | Data Set Action | Sträng CL_DATA_SET_ACTION (se appendix 1) | NOTX |

3.3.1 Segmentet för transaktioner med säkerheter

Detta segment omfattar återköpsavtal inklusive repor (inlåning av pengar) och omvända repor (utlåning av pengar), sell/buy-backs (inlåning av pengar) samt buy/sell-backs (utlåning av pengar).

Trepartsrepor och buy/sell-backs:

- Om transaktionens säkerheter kan identifieras med ISIN-kod, ska ISIN-kod rapporteras. I så fall behöver rapportören inte rapportera vilken typ av säkerhet det rör sig om eller någon annan information om säkerheterna.
- Om transaktionens säkerheter inte kan identifieras med ISIN-kod, ska typen av säkerhet rapporteras. I så fall ska CFI-koden1 (classification of financial instruments) användas.
- Om säkerheterna omfattar flera tillgångsklasser, ska CFI-koden anges för den tillgångsklass som utgör störst andel av säkerheterna.

Repor utan fastställd löptid:

- Repor utan fastställd löptid, eller öppna repor, ska rapporteras dagligen från och med likviddagen med löptid över natten. Om uppsägningstid eller andra avtal innebär att första möjliga förfallodag inte kan vara nästa dag, ska första tänkbara datum då affären kan avslutas rapporteras som förfallodag

Exempel 1)

Repa utan fastställd löptid med affärsdag T och likviddag T+2. Dag T+4 ingår parterna avtal om att stänga handeln dag T+6

| Tid | Handelsdag | Likviddag | Förfallodag | Transaktionsnummer (PTI) | Kommentar |
|-----|------------|-----------|-------------|--------------------------|--------------------------------|
| T | T | T+2 | T+3 | <<1>> | Rapportering av ny transaktion |
| T+1 | | | | | Ingen rapportering |
| T+2 | | | | | Ingen rapportering |
| T+3 | T+3 | T+3 | T+4 | <<2>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+4 | T+4 | T+4 | T+5 | <<3>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+5 | T+5 | T+5 | T+6 | <<4>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+6 | | | | | Förfall. Ingen rapportering |

Exempel 2)

Repa utan fastställd löptid med affärsdag T och likviddag T. Dag T+4 ingår parterna avtal om att avsluta affären samma dag och ersätta den med en repa med likviddag T+4 (T+0) och löptid T+6 (T+2)

| Tid | Affärsdag | Likviddag | Förfallodag | Transaktionsnummer (PTI) | Kommentar |
|-----|-----------|-----------|-------------|--------------------------|--------------------------------|
| T | T | T | T+1 | <<1>> | Rapportering av ny transaktion |
| T+1 | T+1 | T+1 | T+2 | <<2>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+2 | T+2 | T+2 | T+3 | <<3>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+3 | T+3 | T+3 | T+4 | <<4>> | Rullning (ny transaktion) |
| T+4 | T+4 | T+4 | T+6 | <<5>> | Ny transaktion med fast löptid |
| T+5 | | | | | Ingen rapportering |

| | | | | | |
|-----|--|--|--|--|--------------------|
| T+6 | | | | | Ingen rapportering |
|-----|--|--|--|--|--------------------|

3.3.1.1. Definition av variabler – segmentet för transaktioner med säkerheter

I nedanstående tabell anges vilken variabel som ska rapporteras för respektive transaktion. Vissa variabler ska endast rapporteras i de fall de är tillgängliga (blåmarkerade fält). Rapportörerna uppmanas dock att rapportera alla variabler, om möjligt.

| Variabelnamn | Beskrivning |
|---|--|
| REPORTED TRANSACTION STATUS | Transaktionsstatus. Anger om transaktionen är: <ul style="list-style-type: none"> • Ny (NEWT) • En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion • En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion • En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion |
| NOVATION STATUS | Anger om transaktionen utgör en novation (byte av motpart) <i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i> |
| UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | Unik kod som identifierar transaktionen <i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i> |
| PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Bankens eget interna transaktionsnummer. Denna PTI-kod ska vara unik för varje marknadssegment och rapporteringsenhet. |
| RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Om transaktionen är en novation ska ursprunglig PTI-kod rapporteras. <i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i> |
| COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | PTI-kod som har tilldelats av motparten <i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i> |
| COUNTERPARTY IDENTIFICATION | Motpartens LEI-kod COUNTERPARTY SECTOR och COUNTERPARTY LOCATION måste användas för motparter utan LEI-kod. |

| | |
|-------------------------------|--|
| COUNTERPARTY SECTOR | <p>Anger motpartens institutionella sektor, t.ex. icke-finansiellt bolag, offentlig sektor osv.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR måste rapporteras för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Sctr" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |
| COUNTERPARTY LOCATION | <p>Anger landskod (ISO) för landet där motparten är hemmahörande.</p> <p>COUNTERPARTY LOCATION ska anges för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Lctn" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |
| TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION | <p>LEI-kod för trepartsombudet</p> <p><i>Obligatorisk för alla trepartstransaktioner</i></p> |
| TRADE DATE | <p>Dag och tidpunkt då parterna ingick ett avtal. Om tidpunkt saknas rapporteras enbart datum.</p> |
| SETTLEMENT DATE | <p>Dag då affären avvecklas. Om transaktionen avser en rullning av en tidigare rapporterad affär, rapporteras rullningsdatumet. Tekniska fel eller andra omständigheter som leder till att den faktiska likviddagen avviker från avtalad likviddag innebär inte att en ändring (Amendment) behöver rapporteras.</p> |
| MATURITY DATE | <p>Förfallodag.</p> <p>Om transaktioner saknar fastställd förfallodag, ska förfallodagen vara första dagen då affären kan avslutas.</p> |
| TRANSACTION TYPE | <p>Anger om transaktionen avser in- eller utlåning.</p> |
| TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | <p>Nominellt belopp i SEK som lånas in eller ut. Det måste anges att beloppet är i SEK.</p> |
| RATE TYPE | <p>Anger om avtalet ingås till fast eller rörlig ränta.</p> |
| DEAL RATE | <p>Anger avtalsräntan som följer ränteberäkningskonventionen ACT/360. Värdet kan vara positivt eller negativt. Värdet ska utgöra den avtalade ränta som ersätter den utlånande parten för transaktionen.</p> <p><i>Variabeln ska enbart rapporteras om det rör sig om fast ränta.</i></p> |

| | |
|----------------------|--|
| REFERENCE RATE INDEX | <p>Anger ISIN-koden för den underliggande referensräntan i en transaktion med rörlig ränta.</p> <p>Om referensräntan saknar ISIN-kod ska den ISIN-kompatibla kod som anges i appendix 2 rapporteras.</p> <p>Variabeln finns i blocket "FloatingRateRepurchaseAgreement" i TORA-meddelandet.</p> |
| BASIS POINT SPREAD | <p>Baspunkter som läggs till eller dras ifrån den underliggande referensräntan.</p> <p><i>Endast tillämpligt på avtal med flytande ränta</i></p> |
| BROKERED DEAL | <p>Denna variabel anger om transaktionen var anordnad av en tredjepart, eller via en elektronisk handelsplattform driven av en tredjepart, på uppdrag av rapportören.</p> |
| COLLATERAL ISIN | <p>Anger ISIN-kod för den tillgång som ställs som säkerhet.</p> <p>COLLATERAL ISIN kan klassificeras i tre olika kategorier i "Valuation"-blocket i "Collateral"-blocket i TORA-meddelandet:</p> <ul style="list-style-type: none"> • En säkerhet om det värdepapper som används som säkerhet kan identifieras med separat ISIN-kod • Flera säkerheter om de värdepapper som används som säkerhet kan identifieras med separata ISIN-koder • Säkerhetsmassa om de värdepapper som används som säkerhet är en pool av värdepapper. Om säkerhetsmassan kan identifieras med en generisk ISIN-kod ska ISIN-koden rapporteras. I annat fall ska det rapporteras i COLLATERAL TYPE-fältet i "OtherCollateral"-blocket i TORA-meddelandet <p>Detta fält är valfritt för:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Treparsrepor mot en säkerhetsmassa utan generisk ISIN-kod • Säkerheter utan ISIN-kod <p>Om COLLATERAL ISIN inte rapporteras, måstefälten COLLATERAL TYPE, COLLATERAL ISSUER SECTOR och COLLATERAL POOL rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "ISIN" i TORA-meddelandet.</p> |
| COLLATERAL POOL | <p>Anger om de värdepapper som används som säkerhet ingår i en säkerhetsmassa</p> <p>Variabeln heter "PoolSts" och finns i "OtherCollateral"-blocket i TORA-meddelandet.</p> |

| | |
|------------------------------|--|
| COLLATERAL TYPE | <p>Anger tillgångsklassen för de värdepapper som används som säkerhet. Om säkerheterna omfattar flera tillgångsklasser, ska CFI-koden anges för den tillgångsklass som utgör störst andel av säkerheterna.</p> <p><i>Detta fält är obligatoriskt om säkerheten inte kan identifieras med ISIN-kod. Om enskilda ISIN-koder rapporteras ska detta fält inte rapporteras.</i></p> <p>Variabeln heter "Tp" och finns i "OtherCollateral"-blocket i TORA-meddelandet.</p> |
| COLLATERAL ISSUER SECTOR | <p>Anger institutionell sektor för emittenten av de säkerheter som används i transaktionen.</p> <p><i>Om enskilda ISIN-koder rapporteras ska detta fält inte rapporteras.</i></p> <p>Variabeln heter "Sctr" och finns i "OtherCollateral"-blocket i TORA-meddelandet.</p> |
| SPECIAL COLLATERAL INDICATOR | <p>Denna variabel identifierar alla repor i förhållande till generell säkerhet (GC) och särskild säkerhet</p> <ul style="list-style-type: none"> • GC-repor är repor där den som lånar ut värdepapper väljer vilka värdepapper som ska ställas som säkerhet enligt förutbestämda kriterier • Särskild säkerhet är repor där den som lånar ut kontanta medel anger att ett visst värdepapper ska vara säkerhet <p><i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i></p> |
| COLLATERAL NOMINAL AMOUNT | <p>Denna variabel motsvarar det nominella belopp i svenska kronor som ställs som säkerhet. För en obligation är detta det nominella belopp av den obligation som ställs som säkerhet.</p> <p><i>Detta fält är valfritt för trepartstransaktioner mot en säkerhetsmassa utan generisk ISIN-kod och säkerheter som saknar ISIN-kod.</i></p> <p><i>Om mer än ett värdepapper ställs som säkerhet ska det nominella beloppet för varje värdepapper rapporteras.</i></p> <p><i>Variabeln heter "NominalAmount" i TORA-meddelandet. Det ska anges att rapporteringen görs i SEK.</i></p> |
| COLLATERAL HAIRCUT | <p>Anger värderingsavdraget för säkerheten. Värderingsavdraget beräknas på följande sätt:</p> <p>$100 - (\text{utlånade eller inlånade kontanta medel/marknadsvärde inklusive ränta}) * 100.$</p> <p>Detta fält är bara obligatoriskt för repor som har ett enda värdepapper som säkerhet, och valfritt för trepartsrepor och samtliga transaktioner mot en säkerhetsmassa.</p> <p>Variabeln finns i "Collateral"-blocket och heter "Hrcut" i TORA-</p> |

| | |
|--|--------------|
| | meddelandet. |
|--|--------------|

3.3.1.2. Variabelkoder – segmentet för transaktioner med säkerheter

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|--|--|-----------|
| S10 | REPORTED TRANSACTION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATU (se appendix 1) | NEWT |
| S15 | NOVATION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_NOVATION_STATUS (se appendix 1) | NONO |
| S20 | UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | Sträng. Maxlängd: 105 Unikt transaktions-ID (UTI) Upp till 105 alfanumeriska tecken. 4 specialtecken tillåts: ":" , "." , "-" , "_" Specialtecken får inte användas i början eller slutet. Mellanrum får inte användas. | |
| S30 | PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | a1b2-dd-4 |
| S35 | RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |

| | | | |
|-----|---|---|---|
| S40 | COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |
| S50 | COUNTERPARTY IDENTIFICATION | Sträng. Längd: 20 LEI-koden (Legal Entity Identifier) är en 20-siffrig alfanumerisk kod som är unik för företag som är verksamma på finansiella marknader. (ISO17442) | <<549300VLYM2XZE4JF95>> avser Riksbanken |
| S60 | COUNTERPARTY SECTOR | Sträng. Maxlängd: 4 Avser institutionell sektor enligt ENS 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se appendix 1) | <<S11>> avser icke-finansiella bolag |
| S70 | COUNTERPARTY LOCATION | Sträng. Längd: 2 [ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se appendix 1) | <<SE>> avser SWEDEN |
| S80 | TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION | Samma format som 'COUNTERPARTY IDENTIFICATION' | |
| S90 | TRADE DATE | Datum/tid [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm eller YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Information om tidszon (+/-hh:mm) ska inkluderas. Det är inte tillåtet att ange lokal tid utan <<+/-hh:mm>>. <i>Alt.</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen | 2019-01-03T09:15:00+00:00 avser den 3 januari 2019 kl. 9:15 (UTC) <i>Alt.</i> 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |

| | | | |
|------|----------------------------|---|---|
| | | CET. | |
| S100 | SETTLEMENT DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| S110 | MATURITY DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| S120 | TRANSACTION TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (se appendix 1) | "BORR" står för inlåning "LEND" står för utlåning |
| S130 | TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | Numerisk. Max total längd: 18 Positivt tal Decimaler: upp till 5 Valutakod [ISO 4127] | 1 000 000 SEK, där "SEK" står för svenska kronor. Rapporterad valuta ska alltid vara SEK. |
| S140 | RATE TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_RATE_TYPE (se appendix 1) | "VARI" står för rörlig ränta |
| S150 | DEAL RATE | Numerisk. Max total längd: 11 Positivt eller negativt tal Decimaler: upp till 10 Enhet: Procentenheter | 5.123 står för en ränta på 5,123 procent. |
| S160 | REFERENCE RATE INDEX | Sträng. Längd: 12 ISIN-kod [ISO 6166] eller ISIN-kompatibel kod från appendix 2. | 'STIBOR3MXXXX' står för 3 månaders STIBOR. |

| | | | |
|------|------------------------------|--|---|
| S170 | BASIS POINT SPREAD | Numerisk. Max total längd: 18 Positivt eller negativt tal Decimaler: 0 Enhet: Baspunkter | 512 avser en spread på 5,123 procent. 5,123 procent avrundas nedåt till 5,12 procent och omvandlas till baspunkter. |
| S180 | COLLATERAL ISIN | Sträng. Längd: 12 Om säkerheterna omfattar flera olika värdepapper kan flera ISIN-koder rapporteras. [ISO 6166] | "SE0009496367" avser svensk statsobligation (SGB1060) |
| S190 | COLLATERAL POOL | Sträng. Längd: 4 CL_COLLATERAL_POOL (se appendix 1) | "POOL" står för poolsäkerheter |
| S200 | COLLATERAL TYPE | Sträng. Längd: 6 CFI-koden måste användas. [ISO 10962] | "ESXXXX" står för aktier. |
| S210 | COLLATERAL ISSUER SECTOR | Sträng. Maxlängd: 4 Avser institutionell sektor enligt ENS 2010. CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR (se appendix 1) | "S13" står för offentlig förvaltning |
| S220 | SPECIAL COLLATERAL INDICATOR | Sträng. Längd: 4 CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR (se appendix 1) Valfritt. | "GENE" står för generell säkerhet (GC). "SPEC" står för särskild säkerhet. |
| S230 | COLLATERAL NOMINAL AMOUNT | Numerisk. Max total längd: 18 Positivt tal Om säkerheterna omfattar flera olika säkerheter kan flera belopp rapporteras. Decimaler: upp till 5 Valuta [ISO 4127] | 1 000 000 000 SEK, där 'SEK' avser svenska kronor. Rapporterad valuta ska alltid vara SEK. |
| S240 | COLLATERAL HAIRCUT | Numerisk. Max total längd: 11 Positivt eller negativt tal Decimaler: upp till 10 Enhet: Procentenheter | 1.234 står för ett värderingsavdrag på 1,234 procent |
| S250 | BROKERED DEAL | Sträng. Längd: 4 CL_BROKERED_DEAL (see appendix 1) | 'BROK' står för en transaktion anordnad av en tredjepart. |

3.3.2 Segmentet för transaktioner utan säkerheter

Segmentet för transaktioner utan säkerhet omfattar:

- i. Transaktioner i form av mottagen inlåning (deposits), annan inlåning utan säkerhet samt emission av korta skuldinstrument.
- ii. Transaktioner i form av 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.

Som huvudregel ska inlåning rapporteras med löptid över natten. Rapporteringen av inlåning med fast löptid osv. ska dock återspegla den första möjliga dag då uttag kan göras. Rullning av inlåning ska rapporteras som en ny transaktion med ett nytt transaktions-ID.

Exempel: Inlåning med 5 dagars uppsägningstid.

Nedanstående tabell visar hur inlåning som har 5 dagars uppsägningstid och tas emot dag T ska rapporteras. Dag T+10 aviserar insättaren om uttag och tar ut pengarna dag T+15.

| Transaktion | Dag | Belopp | Transaktions-ID. (PTI) | Löptid |
|---------------------------------|------|------------------------|------------------------|---------|
| Ny inlåning | T | 100 milj. | <<1>> | 5 dagar |
| Rullning | T+1 | 100 milj. | <<2>> | 5 dagar |
| ... | ... | ... | ... | ... |
| Rullning och avisering om uttag | T+10 | 100 milj. | <11>> | 5 dagar |
| Rullning | T+11 | 100 milj. | <<12>> | 5 dagar |
| ... | ... | ... | ... | ... |
| | T+14 | 100 milj. | <<15>> | O/N |
| Uttag | T+15 | 0 (ingen rapportering) | – | |

3.3.2.1. Definition av variabler – segmentet för transaktioner utan säkerhet

| Variabelnamn | Beskrivning |
|--------------|-------------|
|--------------|-------------|

| | |
|---|--|
| REPORTED TRANSACTION STATUS | <p>Transaktionsstatus. Anger om transaktionen är:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ny (NEWT) • En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion • En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion • En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion |
| NOVATION STATUS | <p>Anger om transaktionen utgör en novation (byte av motpart)</p> <p><i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i></p> |
| UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | <p>Unik kod som identifierar transaktionen</p> <p><i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i></p> |
| PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>Bankens eget interna transaktionsnummer. Denna PTI-kod ska vara unik för varje marknadssegment och rapporteringsenhet.</p> |
| RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>Om transaktionen är en novation ska ursprunglig PTI-kod rapporteras.</p> <p><i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i></p> |
| COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>PTI-kod som har tilldelats av motparten</p> <p><i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i></p> |
| COUNTERPARTY IDENTIFICATION | <p>Motpartens LEI-kod.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR och COUNTERPARTY LOCATION måste användas för motparter utan LEI-kod.</p> |
| COUNTERPARTY SECTOR | <p>Anger motpartens institutionella sektor, t.ex. icke-finansiellt bolag, offentlig sektor osv.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR måste rapporteras för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Sctr" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| COUNTERPARTY LOCATION | <p>Anger landskod (ISO) för landet där motparten är hemmahörande.</p> <p>COUNTERPARTY LOCATION måste anges för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Lctn" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |
| TRADE DATE | <p>Dag och tidpunkt då parterna ingick ett avtal. Om tidpunkt saknas rapporteras enbart datum. TRADE DATE ska alltid infalla före eller samtidigt med SET-TLEMENT DATE. Vid novation kan TRADE DATE infalla efter SETTLEMENT DATE.</p> |
| SETTLEMENT DATE | <p>Dag då affären avvecklas. Om transaktionen avser en rullning av en tidigare rapporterad affär, rapporteras rullningsdatumet. Tekniska fel eller andra omständigheter som leder till att den faktiska likviddagen avviker från avtalad likviddag innebär inte att tillägg behöver rapporteras.</p> |
| MATURITY DATE | <p>Datum när låntagaren ska betala tillbaka beloppet till långivaren eller när skuldinstrumentet förfaller och ska återbetalas</p> <p>För instrument med köp- eller säljoptioner ska slutlig förfalldag rapporteras.</p> <p>Inlåning ska rapporteras med löptid över natten. För inlåning som inte kan tas ut över natten, ska första möjliga uttagsdatum rapporteras.</p> |
| INSTRUMENT TYPE | <p>Denna variabel anges vilket instrument som används för inlåning/utlåning.</p> |
| TRANSACTION TYPE | <p>Denna variabel anger om transaktionen avser in- eller utlåning.</p> |
| TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | <p>Det nominella belopp i SEK som lånas in eller ut. Det måste anges att beloppet är i SEK.</p> |
| TRANSACTION DEAL PRICE | <p>Värdepapperets totalpris på emissionsdagen eller vid handelstidpunkten angivet i procentenheter.</p> <p>För inlåning utan säkerhet ska transaktionspriset rapporteras som 100.</p> <p>Variabeln heter "DealPric" i TORA-meddelandet.</p> |

| | |
|----------------------|---|
| RATE TYPE | <p>Möjliga värden:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Fast ränta för inlåning och skuldinstrument med fast ränta • Rörlig ränta för skuldinstrument och inlåning utan säkerhet där betalningen vid förfall eller för en period är beroende av värdet på en underliggande referensränta |
| DEAL RATE | <p>Räntan som betalas eller tas emot på inlåning, uttryckt enligt ACT/360-konventionen. För skuldinstrument ska räntan vid emissions- eller handelstidpunkten rapporteras enligt ACT/360-konventionen.</p> <p>Ska endast rapporteras om RATE TYPE är FIXE (fast ränta).</p> |
| REFERENCE RATE INDEX | <p>ISIN-kod för den underliggande referensränta som används för att beräkna periodiska räntebetalningar.</p> <p>Om referensräntan saknar ISIN-kod ska den ISIN-kompatibla kod som definieras i appendix 2 användas.</p> <p><i>Detta fält gäller endast om instrumentet har rörlig ränta.</i></p> <p>Denna variabel finns i "FloatingRateNote"-blocket i TORA-meddelandet.</p> |
| BASIS POINT SPREAD | <p>Antal baspunkter som läggs till eller dras ifrån (för ett negativt tal) från referensräntan för att beräkna räntebetalningen för en viss period.</p> <p><i>Denna variabel gäller endast för instrument med rörlig ränta.</i></p> <p>Variabeln finns i "FloatingRateNote"-blocket i TORA-meddelandet.</p> |
| BROKERED DEAL | <p>Denna variabel anger om transaktionen var anordnad av en tredjepart, eller via en elektronisk handelsplattform driven av en tredjepart, på uppdrag av rapportören.</p> <p>.</p> |

| | |
|------------------------|---|
| CALL OR PUT | <p>Detta fält anger om instrumentet har en köp- (call) eller säljoption (put). Om instrumentet har både en köp- och en säljoption ska båda rapporteras.</p> <p><i>Detta fält gäller enbart om instrumentet har en köp- och/eller säljoption.</i></p> <p><i>För instrument med köp- eller säljoption ska minst ett av fälten FIRST CALL/PUT DATE eller CALL/PUT NOTICE PERIOD rapporteras.</i></p> <p>Variabeln finns i "CallPutOption"-blocket och heter "Tp" i TORA-meddelandet.</p> |
| FIRST CALL/PUT DATE | <p>Första dag då köp- eller säljoptionen kan utnyttjas. Detta fält är obligatoriskt för instrument med köp- eller säljoption som kan utnyttjas på ett eller flera förutbestämda datum.</p> <p><i>Detta fält gäller enbart för instrument med köp- och/eller säljoption.</i></p> <p>Variabeln finns i "CallPutOption"-blocket och heter "EarlstExrcDt" i TORA-meddelandet.</p> |
| CALL/PUT NOTICE PERIOD | <p>Antalet kalenderdagar som instrumentets ägare måste avisera instrumentets emittent innan optionen utnyttjas.</p> <p><i>Detta fält gäller enbart för instrument med köp- och/eller säljoption.</i></p> <p>Variabeln finns i "CallPutOption"-blocket och heter "NtcePrd" i TORA-meddelandet.</p> |

3.3.2.2. Variabelkoder – segmentet för transaktioner utan säkerhet

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|-----------------------------|--|---------|
| U10 | REPORTED TRANSACTION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATU (se appendix 1) | NEWT |
| U15 | NOVATION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_NOVATION_STATUS (se appendix 1) | NONO |

| | | | |
|-----|---|--|---|
| U20 | UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | Sträng. Maxlängd: 105 Unikt transaktions-ID (UTI) Upp till 105 alfanumeriska tecken. 4 specialtecken tillåts: ":", ".","-", "_" Specialtecken får inte användas i början eller slutet. Mellanrum får inte användas. | |
| U30 | PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | a1b2-dd-4 |
| U35 | RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |
| U40 | COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |
| U50 | COUNTERPARTY IDENTIFICATION | Sträng. Längd: 20 LEI-koden (Legal Entity Identifier) är en 20-siffrig alfanumerisk kod som är unik för företag som är verksamma på finansiella marknader. (ISO17442) | <<549300VLYM2XZE4FJF95>> avser Riksbanken |
| U60 | COUNTERPARTY SECTOR | Sträng. Maxlängd: 4 Avser institutionell sektor enligt ENS 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se appendix 1) | <<S11>> avser icke-finansiella företag |
| U70 | COUNTERPARTY LOCATION | Sträng. Längd: 2 [ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se appendix 1) | <<SE>> avser SWEDEN |

| | | | |
|------|----------------------------|--|--|
| U80 | TRADE DATE | Datum/tid [ISO 8601] ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss+/- hh:mm eller ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss.sss+/- hh:mm Information om tidszon (+/- hh:mm) ska inkluderas. Det är inte tillåtet att ange lokal tid utan <<+/-hh:mm>>. <i>Alt.</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01- 03T09:15:00+00:00 avser den 3 januari 2019 kl. 9:15 (UTC) <i>Alt.</i> 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| U90 | SETTLEMENT DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| U100 | MATURITY DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| U110 | INSTRUMENT TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_INSTRUMENT_TYPE (se appendix 1) | "DPST" står för inlåning |
| U120 | TRANSACTION TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (se appendix 1) | "BORR" står för inlåning "LEND" står för utlåning |
| U130 | TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | Numerisk. Max totallängd: 18 Positivt tal Decimaler: upp till 5 Valutakod [ISO 4127] | 1 000 000 SEK, där 'SEK' står för svenska kronor. Rapporterad valuta ska alltid vara SEK. |
| U140 | TRANSACTION DEAL PRICE | Numerisk. Max totallängd: 11 Decimaler: upp till 10 Enhet: Procentenheter | 98.123 står för 98,123 % |
| U150 | RATE TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_RATE_TYPE (se appendix 1) | "VARI" står för rörlig ränta |

| | | | |
|------|------------------------|--|---|
| U160 | DEAL RATE | Numerisk. Max totallängd: 11 Positivt eller negativt tal Decimaler: upp till 10 Enhet: Procentenheter | 5.123 står för en ränta på 5,123 procent. |
| U170 | REFERENCE RATE INDEX | Sträng. Längd: 12 ISIN-kod [ISO 6166] eller ISIN-kompatibel kod från appendix 2. | 'STIBOR3MXXXX' står för 3 månaders STIBOR. |
| U180 | BASIS POINT SPREAD | Numerisk. Max totallängd: 18 Positivt eller negativt tal Decimaler: 0 Enhet: Baspunkter | 512 avser en spread på 5,123 procent. 5,123 procent avrundas nedåt till 5,12 procent och omvandlas till baspunkter. |
| U190 | CALL OR PUT | Sträng. Längd: 4 CL_CALL_PUT (se appendix 1) | 'CALL' eller 'PUT' |
| U200 | FIRST CALL/PUT DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| U210 | CALL/PUT NOTICE PERIOD | Numerisk. Max totallängd: 18 Decimaler: 0 | "7" står för en uppsägningstid på en vecka. |
| U220 | BROKERED DEAL | Sträng. Längd: 4 CL_BROKERED_DEAL (see appendix 1) | 'BROK' står för en transaktion anordnad av en tredjepart. |

3.3.3 Valutaswappar

Valutaswappar omfattar 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.

3.3.3.1. Definition av variabler – valutaswappar

I nedanstående tabell anges vilken variabel som ska rapporteras för respektive transaktion. Vissa variabler ska endast rapporteras i de fall de är tillgängliga (blåmarkerade fält). Rapportörerna uppmanas dock att rapportera alla variabler, om möjligt.

| Variabelnamn | Beskrivning |
|---|--|
| REPORTED TRANSACTION STATUS | <p>Transaktionsstatus. Anger om transaktionen är:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ny (NEWT) • En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion • En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion • En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion |
| NOVATION STATUS | <p>Anger om transaktionen utgör en novation (byte av motpart)</p> <p><i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i></p> |
| UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | <p>Unik kod som identifierar transaktionen</p> <p><i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i></p> |
| PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>Bankens eget interna transaktionsnummer. Denna PTI-kod ska vara unik för varje marknadssegment och rapporteringsenhet.</p> |
| RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>Om transaktionen är en novation ska ursprunglig PTI-kod rapporteras.</p> <p><i>Rapporteras enbart i tillämpliga fall</i></p> |
| COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | <p>PTI-kod som har tilldelats av motparten</p> <p><i>Ska rapporteras om den finns tillgänglig</i></p> |
| COUNTERPARTY IDENTIFICATION | <p>Motpartens LEI-kod.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR och COUNTERPARTY LOCATION måste användas för motparter utan LEI-kod.</p> |
| COUNTERPARTY SECTOR | <p>Anger motpartens institutionella sektor, t.ex. icke-finansiellt bolag, offentlig sektor osv.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR måste rapporteras för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Sctr" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |

| | |
|---------------------------------|--|
| COUNTERPARTY LOCATION | <p>Anger landskod (ISO) för landet där motparten är hemmahörande.</p> <p>COUNTERPARTY LOCATION måste anges för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.</p> <p>Variabeln heter "Lctn" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.</p> |
| TRADE DATE | <p>Dag och tidpunkt då parterna ingick ett avtal. Om tidpunkt saknas rapporteras enbart datum.</p> <p>TRADE DATE ska alltid infalla före eller samtidigt med SETTLEMENT DATE. Vid novation kan TRADE DATE infalla efter SETTLEMENT DATE.</p> |
| VALUE DATE | <p>Anger likviddagen vid swappavtalets start (near leg).</p> <p>Variabeln heter "SpotValDt" i TORA-meddelandet.</p> |
| MATURITY DATE | <p>Anger förfallodag. Avser datum för förfall (far leg).</p> |
| FX TRANSACTION TYPE | <p>Anger om SEK säljs eller köps på likviddagen (near leg).</p> <p>Variabeln heter "TxTp" i TORA-meddelandet.</p> |
| TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | <p>Anger det nominella beloppet SEK som säljs eller köps på likviddagen.</p> |
| FOREIGN CURRENCY CODE | <p>Anger den internationella ISO-koden för den valuta som säljs eller köps mot SEK, t.ex. EUR.</p> <p>Variabeln finns i "ForeignExchange"-blocket och heter "FrgnCcy" i TORA-meddelandet.</p> |
| FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE | <p>Anger tillämplig valutakurs vid swappavtalets start (near leg). Kursen ska uttryckas som antal SEK per 1 enhet utländsk valuta.</p> <p>Variabeln finns i "ForeignExchange"-blocket och heter "XchgSpotRate" i TORA-meddelandet.</p> |
| FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS | <p>Anger skillnaden mellan terminskursen och spotkursen uttryckt i pips: (Terminskurs – spotkurs) * 10 000</p> <p>Variabeln finns i "ForeignExchange"-blocket och heter "XchgFwdPt" i TORA-meddelandet.</p> |

3.3.3.2. Variablekoder – valutaswappar

| Variabelkod | Variabelnamn | Typ | Exempel |
|-------------|---|---|---|
| F10 | REPORTED TRANSACTION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATU (se appendix 1) | NEWT |
| F15 | NOVATION STATUS | Sträng. Längd: 4 CL_NOVATION_STATUS (se appendix 1) | NONO |
| F20 | UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER | Sträng. Maxlängd: 105 Unikt transaktions-ID (UTI) Upp till 105 alfanumeriska tecken. 4 specialtecken tillåts: ":", ".", ",", "_" Specialtecken får inte användas i början eller slutet. Mellanrum får inte användas. | |
| F30 | PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | a1b2-dd-4 |
| F35 | RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |
| F40 | COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION | Sträng. Maxlängd: 105 | |
| F50 | COUNTERPARTY IDENTIFICATION | Sträng. Längd: 20 LEI-koden (Legal Entity Identifier) är en 20-siffrig alfanumerisk kod som är unik för företag som är verksamma på finansiella marknader. (ISO17442) | <<549300VLYM2XZE4FJF95>> avser Riksbanken |

| | | | |
|------|----------------------------|--|--|
| F60 | COUNTERPARTY SECTOR | Sträng. Maxlängd: 4 Avser institutionell sektor enligt ENS 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se appendix 1) | <<S11>> avser icke-finansiella bolag |
| F70 | COUNTERPARTY LOCATION | Sträng. Längd: 2 [ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se appendix 1) | <<SE>> avser SWEDEN |
| F80 | TRADE DATE | Datum/tid [ISO 8601] ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss+/- hh:mm eller ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss.sss+/- hh:mm Information om tidszon (+/- hh:mm) ska inkluderas. Det är inte tillåtet att ange lokal tid utan <<+/-hh:mm>>. <i>Alt.</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03T09:15:00+00:00 avser den 3 januari 2019 kl. 9:15 (UTC) <i>Alt.</i> 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| F90 | VALUE DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| F100 | MATURITY DATE | Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Datum ska följa tidszonen CET. | 2019-01-03 avser den 3 januari 2019 |
| F110 | FX TRANSACTION TYPE | Sträng. Längd: 4 CL_FX_TRANSACTION_TYPE (se appendix 1) | "BUYI" står för SEK som har köpts vid swappavtalets start (near leg) |
| F120 | TRANSACTION NOMINAL AMOUNT | Numerisk. Max totallängd: 18 Positivt tal. Decimaler: upp till 5 Valutakod [ISO 4127] | 1 000 000 000 SEK, där "SEK" står för svenska kronor. Rapporterad valuta ska alltid vara SEK. |

| | | | |
|------|--|--|---|
| F130 | FOREIGN CURRENCY CODE | Sträng. Längd: 3 [ISO 4217] CL_FCC (se appendix 1) | "USD" står för amerikanska dollar |
| F140 | FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE | Numerisk. Max totallängd: 11 Decimaler: upp till 10 | 9.5431 står för en växelkurs som motsvarar 9,5431 SEK per 1 USD. |
| F150 | FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS | Numerisk. Max totallängd: 18 Positivt eller negativt tal. Decimaler: upp till 17 | –350 om spotkursen för USDSEK är 9,5431 och terminkursen är 9.5081 |

Appendix 1 – Kodlista

| Kodnamn | Input | Beskrivning |
|-----------------------------|--------------|--|
| CL_BROKERED_DEAL | BILA | Transaktionen var anordnad direkt med motparten |
| | BROK | Transaktionen var anordnad av en tredjepart |
| CL_CALL_PUT | CALL | Köption |
| | PUTO | Säljoption |
| CL_FCC | Se ISO 4217 | |
| CL_CFI | Se ISO 10962 | |
| CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR | S11 | Icke-finansiella bolag |
| | S12 | Finansiella bolag |
| | S121 | Centralbanker |
| | S122 | Monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken |
| | S123 | Penningmarknadsfonder |
| | S124 | Investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder |
| | S125 | Andra finansförmedlare, utom försäkringsbolag och pensionsinstitut |
| | S126 | Finansiella servicebolag |
| | S127 | Koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag |
| | S128 | Försäkringsbolag |
| | S129 | Pensionsinstitut |
| | S13 | Offentlig förvaltning |
| | S14 | Hushåll |
| | S15 | Hushållens icke-vinstdrivande organisationer |

| | | |
|------------------------|-----------------------|---|
| CL_CO_POOL | POOL | Säkerhetsmassa |
| | NOPL | Enskild säkerhet eller flera säkerheter |
| CL_COUNTERPARTY_SECTOR | S11 | Icke-finansiella bolag |
| | S121 | Centralbanker |
| | S122 | Monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken |
| | S123 | Penningmarknadsfonder |
| | S124 | Investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder |
| | S125 | Andra finansförmedlare, utom försäkringsbolag och pensionsinstitut |
| | S126 | Finansiella servicebolag |
| | S127 | Koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag |
| | S128 | Försäkringsbolag |
| | S129 | Pensionsinstitut |
| | S13 | Offentlig förvaltning |
| CL_COUNTRY | Se ISO 3166-1 alpha-2 | |
| CL_DATASETACTION | NOTX | Ingen transaktion |
| CL_FX_TRANSACTION_TYPE | BUYI | Anger att SEK köps på likviddagen, dvs. near leg |
| | SELL | Anger att SEK säljs på likviddagen, dvs. near leg |
| CL_INSTRUMENT_TYPE | DPST | Inlåning/Utlåning (Deposit) |
| | CEOD | Inlåningsbevis (Certificate of Deposit) |
| | COPR | Företagscertifikat (Commercial Paper) |
| | ABCP | Tillgångssäkrade företagscertifikat (Asset backed commercial paper) |
| | FRNT | Skuldebrev med rörlig ränta (Floating rate note) |

| | | |
|---------------------------------|-----------------|---|
| | OTHR | Andra korta skuldinstrument |
| CL_MARKET_SEGMENT | auth.012.001.02 | Segmentet för transaktioner med säkerhet |
| | auth.013.001.02 | Segmentet för transaktioner utan säkerhet |
| | auth.014.001.02 | Valutaswappar |
| CL_NOVATION_STATUS | NONO | Ingen novation |
| | NOVA | Novation |
| CL_RATE_TYPE | FIXE | Fast ränta |
| | VARI | Rörlig ränta |
| CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS | AMND | Amendment |
| | CANC | Cancellation |
| | CORR | Correction |
| | NEWT | Ny transaktion |
| CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR | GENE | Generell säkerhet (GC) |
| | SPEC | Särskild säkerhet |
| CL_TRANSACTION_TYPE | BORR | Inlåning |
| | LEND | Utlåning |

Appendix 2 – Kodlista för referensvärden utan ISIN-kod

Anm: Preliminära koder

| Referensränta | Input (ISIN-kompatibelkod) |
|----------------------|-----------------------------------|
| Swestr O/N | SWESTRONXXX0 |
| Styrränta | RIKSREPOXXX0 |
| STIBOR T/N | STIBORTNXXX0 |
| STIBOR 1 vecka | STIBOR1WXXX0 |
| STIBOR 1M | STIBOR1MXXX0 |
| STIBOR 2M | STIBOR2MXXX0 |
| STIBOR 3M | STIBOR3MXXX0 |
| STIBOR 6M | STIBOR6MXXX0 |

Appendix 3 – Daglig rutin för rapportering av de transaktioner som ligger till grund för Swestr

1. Inrapportering av transaktioner
 - a. TORA är tillgängligt för inrapportering kl. 16:30 – 20:00 samt 00:00 – 07:00.
 - b. Deadline för inrapportering är kl. 07:00.
 - c. Påminnelse via mail skickas 07:01.
2. Valideringssteg för kontroll av extremvärden
 - a. Hantering av transaktioner som har flaggats vid kontroll av ränta och volym mot historiska handelsmönster.
 - b. Valideringen sker i samband med den tekniska valideringen som genomförs direkt när TORA tar emot en transaktionsrapport och återkopplas direkt till rapportör via valideringsfiler (s.k. Ack-filer).
 - c. Rapportörer återkopplar till Riksbanken via mail till TORA-brevlådan och konfirmerar, alternativt meddelar ändringar i flaggade transaktioner. Valideringsmail måste alltid innehålla följande information för varje flaggad transaktion:
 - i. transaktions-id
 - ii. status (konfirmerad, korrigerad eller cancelerad)
 - iii. verifikationsnummer (finns tillgänglig i Ack-filen)
 - d. Eventuella ändringar eller annulleringar av flaggade transaktioner ska vara inrapporterade till TORA-systemet före nedanstående deadline. För instruktioner om hur ändringar, korrigeringar, cancelleringar eller inrapportering av nya transaktioner, ska rapporteras, se avsnitt 3.3.2.1 *Definition av variabler – segmentet för transaktioner utan säkerhet ovan*.
 - e. Deadline för hantering är kl. 08:15
3. Valideringssteg för kontroll av parmatchning
 - a. Matchning av transaktioner mellan rapportörer, så kallad parmatchning, görs i TORA efter klockan 07:00 men senast kl. 07:30.
 - b. Information från Riksbanken om omatchade transaktioner återkopplas till rapportör via valideringsfiler (s.k. Ack-filer) kort efter att kontrollen utförts.
 - c. Rapportörerna återkopplar till Riksbanken via mail till TORA-brevlådan och konfirmerar eller meddelar ändringar i rapporterade transaktioner. Valideringsmail måste alltid innehålla följande information:
 - i. Konfirmerade transaktioner: volym, räntesats, motpart och transaktions-id.
 - ii. Ändrade transaktioner: volym, räntesats, motpart och transaktions-id, där de variabler som ändrats innehåller information om status före och efter ändring.
 - iii. Cellerade transaktioner: volym, räntesats, motpart och transaktions-id.
 - d. Eventuella ändringar av omatchade transaktioner ska vara inrapporterade till TORA-systemet före nedanstående deadline. För instruktioner om hur ändringar, korrigeringar, cancelleringar eller inrapportering av nya transaktioner, se avsnitt 3.3.2.1 *Definition av variabler – segmentet för transaktioner utan säkerhet ovan*.
 - e. Deadline för hantering är kl. 08:15
4. Publicering
 - a. Referensräntan görs tillgänglig via vårt öppna API och publiceras på

Riksbankens hemsida kl. 09:00

- b. Index och genomsnittsräntor kommer att publiceras 09:05
- 5. Försenad inrapportering och icke-validerade transaktioner
 - a. Transaktioner som av eventuellt tekniskt fel inte tagits med till första beräkningen ska rapporteras till TORA så snart som möjligt.
 - b. Sent inrapporterade transaktioner genomgår samma valideringssteg som ovan.
 - c. Därefter beräknas referensräntan om och jämförs med första publiceringen.
- 6. Eventuell opublicering
 - a. Om skillnaden mellan beräkningarna vid de olika tidpunkterna enligt ovan är 2 eller fler räntepunkter publiceras en ny notering av referensräntan på Riksbank.se, samt görs tillgänglig via vårt öppna API klockan 12.00
 - b. Vid en eventuell opublicering kommer index och genomsnitt att publiceras 12:05
- 7. Uppföljning av utestående oklarheter i rapporterade transaktioner
 - a. Efter klockan 12.00 kan Riksbanken återkoppla till rapportörer angående dagens eller tidigare dagars inrapporterade transaktioner där avvikelser uppdagats.
 - b. Rapportörer ombedes att kontrollera sådana transaktioner och återkoppla till Riksbanken om status och eventuell åtgärder.



SVERIGES RIKSBANK

Tel 08 - 787 00 00

registratorn@riksbank.se

www.riksbank.se

PRODUKTION SVERIGES RIKSBANK)

ISSN ISSN. (online)