

Rapporteringsinstruktioner

**Daglig rapportering av  
penningmarknadsdata**

2024-06-03

DNR 2024-00505

**Version 1.10 av Rapporteringsinstruktioner – daglig rapportering av penningmarknadsdata publiceras 2024-06-03 och träder ikraft samma dag.**

Version	Datum	Beskrivning
1.10	2024-06-03	Förtydligande i sektion 3.3.2 Segmentet för transaktioner utan säkerheter.
1.9	2024-01-30	Förtydligande i sektion 2.4 Penningmarknadens segment.
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 nåbar."
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).  Appendix 3: <i>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> .  Appendix 3: <i>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	25
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](mailto: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

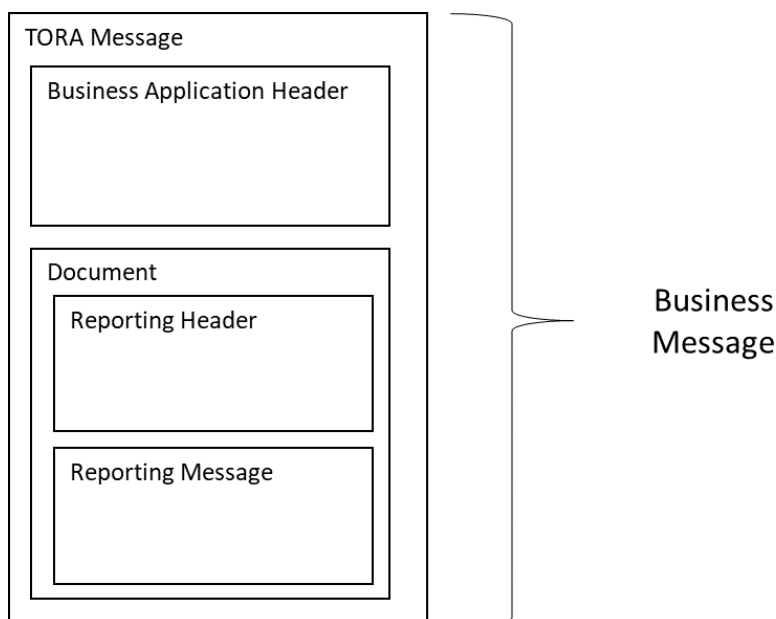
I de fall en eller flera transaktion(er) som skulle ha rapporterats för en specifik dag inte har rapporterats ska denna/dessa transaktion(er) rapporteras så snart som möjligt. Inga ändringar eller tillägg behöver göras i rapporteringen för denna/dessa transaktion(er) för att förtydliga att det är en 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"> <li>• Ny (NEWT)</li> <li>• En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> </ul>
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"> <li>• En säkerhet om det värdepapper som används som säkerhet kan identifieras med separat ISIN-kod</li> <li>• Flera säkerheter om de värdepapper som används som säkerhet kan identifieras med separata ISIN-koder</li> <li>• 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</li> </ul> <p>Detta fält är valfritt för:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Trepartsrepor mot en säkerhetsmassa utan generisk ISIN-kod</li> <li>• Säkerheter utan ISIN-kod</li> </ul> <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"> <li>• GC-repor är repor där den som lånar ut värdepapper väljer vilka värdepapper som ska ställas som säkerhet enligt förutbestämda kriterier</li> <li>• Särskild säkerhet är repor där den som lånar ut kontanta medel anger att ett visst värdepapper ska vara säkerhet</li> </ul> <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><math>100 - (\text{utlånade eller inlånade kontanta medel/marknadsvärde inklusive ränta}) * 100.</math></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 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.
S140	RATE TYPE	Sträng. Längd: 4 CL_RATE_TYPE (se appendix 1)	"VARI" står för rörlig ränta
S150	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.
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. Återköp av emittenten betraktas inte som transaktion på förstahandsmarknad.

Det är enbart avtalad inlåning med fast löptid, uppsägningstid eller andra begränsningar på uttag som ska rapporteras. Motparters egna insättningar på och uttag från t.ex. löpande konton utan restriktioner eller begränsningar och med förutbestämda villkor ska inte rapporteras. Ifall ränta och löptid har avtalats bilateralt ska transaktionen rapporteras oavsett hur likviden hanteras, t.ex. om likviden placeras på ett löpande konto.

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	Transaktionsstatus. Anger om transaktionen är: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Ny (NEWT)</li> <li>• En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> </ul>
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	Anger motpartens institutionella sektor, t.ex. icke-finansiellt bolag, offentlig sektor osv.  COUNTERPARTY SECTOR måste rapporteras för alla transaktioner där COUNTERPARTY IDENTIFICATION inte rapporteras.  Variabeln heter "Sctr" i TORA-meddelandet och finns i "SectorAndLocation"-blocket i "CounterpartyIdentification"-blocket i meddelandet.

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 förfallodag 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"> <li>• Fast ränta för inlåning och skuldinstrument med fast ränta</li> <li>• Rörlig ränta för skuldinstrument och inlåning utan säkerhet där betalningen vid förfall eller för en period är beroende av värdet på en underliggande referensränta</li> </ul>
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"> <li>• Ny (NEWT)</li> <li>• En "amendment (AMND)" på en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "cancellation (CANC)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> <li>• En "correction (CORR)" av en tidigare rapporterad transaktion</li> </ul>
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

<b>Referensränta</b>	<b>Input (ISIN-kompatibelkod)</b>
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. Cancellerade 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](mailto:registratorn@riksbank.se)

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

PRODUKTION SVERIGES RIKSBANK)

ISSN ISSN. (online)