

Rapport om transaktionsunderlag för Swestr

Kvartal 4 2023 (2023-10-01 – 2023-12-31)

Publicerad 2024-02-07

Riksbanken strävar efter så stor transparens som möjligt avseende Swestr. Nedan finns därför information om hur eventuella förändringar av transaktionsunderlaget hade påverkat Swestr-noteringarna om förändringarna varit kända när respektive notering fastställdes. I rapporten finns även sammanfattande information om sammansättningen av transaktionsunderlaget för Swestr.

Påverkan från förändringar av transaktionsunderlaget

Två felaktigheter finns att rapportera under det fjärde kvartalet 2023, det vill säga det var två tillfällen under detta kvartal där förändringar av transaktionsunderlaget i efterhand hade gett en absolutpåverkan på Swestr större än 0,1 räntepunkter.

Tabell 1. Absolutpåverkan på Swestr [ε]

Räntepunkter

#	Värdedag	$0,1 < \epsilon \leq 0,5$	$0,5 < \epsilon \leq 1,0$	$1,0 < \epsilon \leq 2,0$	$2,0 < \epsilon$	Anledning
1	2023-10-24			✓		Administratörsfel
2	2023-11-13	✓				Sen rapportering eller validering

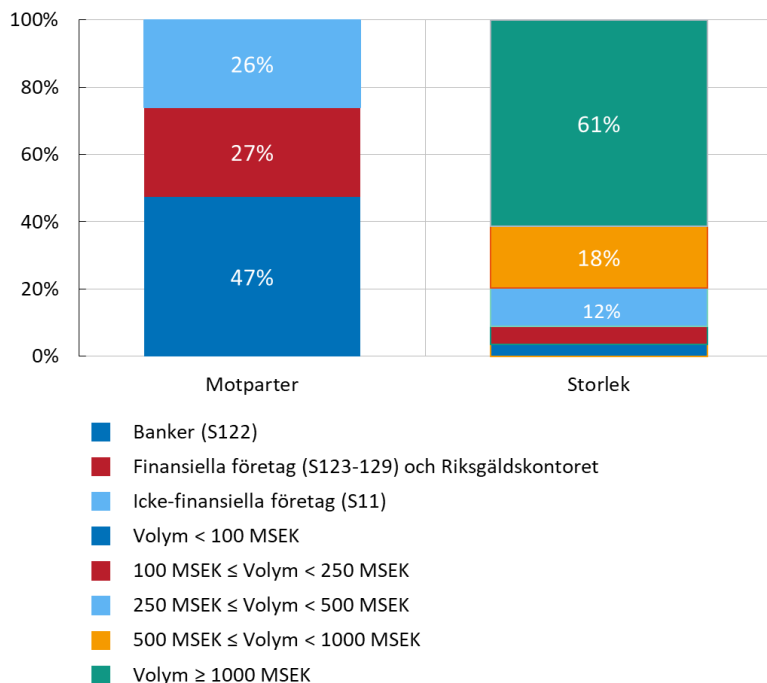
Absolutpåverkan på Swestr i räntepunkter (1 räntepunkt = 0,01 procentenheter). Avstämningsdag för transaktionsunderlaget är 2024-02-01. Datum anges på format ÅÅÅÅ-MM-DD.

Transaktionsunderlagets sammansättning

Under den period om fyra kalenderkvartal som avslutades i och med det fjärde kvartalet 2023 bestod transaktionsunderlaget, före trimning, till 47 procent av rapportörernas transaktioner med banker (S122), till 27 procent av transaktioner med finansiella företag (S123-S129) och Riksgäldskontoret samt till 26 procent av transaktioner med icke-finansiella företag (S11). Fördelningen är volymviktad.

Diagram 1. Transaktionsunderlagets fördelning

Procentuell fördelning av totalvolymen per motparts- och storlekskategori



Avser sammansättningen av det sammantagna transaktionsunderlaget under en period om fyra kalenderkvartal där det sista kvartalet är det kvartal som rapporten avser.

Tabell 1. Sammansättning av transaktionsunderlaget med avseende på motpartskategorier

Procentuell fördelning av det sammantagna transaktionsunderlaget

Sista kvartal	Banker (S122)	Finansiella företag (S123-S129) + RGK	Icke-finansiella företag (S11)
Kv.4, 2023	47	27	26

Avser sammansättningen av det sammantagna transaktionsunderlaget under en period om fyra kalenderkvartal där det sista kvartalet är det kvartal som rapporten avser.

Tabell 2. Sammansättning av transaktionsunderlaget med avseende på transaktionsstorlek

Procentuell fördelning av det sammantagna transaktionsunderlaget

Sista kvartal	Volym < 100 MSEK	100 MSEK ≤ Volym < 250 MSEK	250 MSEK ≤ Volym < 500 MSEK	500 MSEK ≤ Volym < 1000 MSEK	Volym ≥ 1000 MSEK
Kv.4, 2023	3	5	12	18	61

Avser sammansättningen av det sammantagna transaktionsunderlaget under en period om fyra kalenderkvartal där det sista kvartalet är det kvartal som rapporten avser.

Om rapporten

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

Källa för all information i rapporten är Riksbanken.

Påverkan från förändringar av transaktionsunderlaget

Rapporten innehåller information om hur eventuella förändringar, som i efterhand har skett med transaktionsunderlaget för Swestr, skulle ha påverkat Swestr-noteringarna om de varit kända när Swestr fastställdes.

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

Rapporten tar upp samtliga tillfällen där absolutvärdet av skillnaden mellan den fastställda Swestr-noteringen och det värde som beräknas baserat på det förändrade transaktionsunderlaget överstiger 0,1 räntepunkter (dvs. 0,001 procentenheter). För varje tillfälle som rapporten tar upp anges sammanfattande information om varför transaktionsunderlaget förändrats. En eller flera av följande tre orsaker till förändrat transaktionsunderlag anges således för varje tillfälle:

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

Transaktionsunderlagets sammansättning

Rapporten redovisar hur det sammanlagda transaktionsunderlaget har varit fördelat under de senaste fyra kalenderkvartalen, det vill säga sammantaget under det kvartal som rapporten avser och de tre närmast föregående kvartalen. Fördelningen utgår från det faktiskt använda transaktionsunderlaget för respektive Swestr-notering.

Sammansättningen redovisas uppdelat per motpartskategori och per volymkategori för de enskilda underliggande transaktionerna. Sektorkoderna bredvid namnen på motpartskategorierna avser sektorindelning enligt European System of Accounts (ESA2010).

Procentandelarna avrundas till hela procent. På grund av avrundningen summerar dock inte alltid procentandelarna till 100 procent.