

Värdepappersstatistik SVDB

2016

FM9998

Innehåll

0	Allmänna uppgifter	2
0.1	Ämnesområde	2
0.2	Statistikområde	2
0.3	SOS-klassificering	2
0.4	Statistikansvarig	2
0.5	Statistikproducent	2
0.6	Uppgiftsskyldighet	2
0.7	Sekretess och regler för behandling av personuppgifter	3
0.8	Gallringsföreskrifter	3
0.9	EU-reglering	3
0.10	Syfte och historik	3
0.11	Statistikanvändning	3
0.12	Uppläggning och genomförande	3
0.13	Internationell rapportering	4
0.14	Planerade förändringar i kommande undersökningar	4
1	Översikt	5
1.1	Observationsstorheter	5
1.2	Statistiska målstorheter	6
1.3	Utflöden: statistik och mikrodata	6
1.4	Dokumentation och metadata	7
2	Uppgiftsinsamling	8
2.1	Ram och ramförfarande	8
2.2	Urvalsförfarande	9
2.3	Mätinstrument	9
2.4	Insamlingsförfarande	11
2.5	Databeredning	15
3	Statistisk bearbetning och redovisning	18
3.1	Skattningar: antaganden och beräkningsformler	19
3.2	Redovisningsförfaranden	19
4	Slutliga observationsregister	20
4.1	Produktionsversioner	20
4.2	Arkiveringsversioner	20
4.3	Erfarenheter från senaste undersökningsomgången	20
	Bilaga 1 Frågeformulär	21

Statistiska centralbyrån

0 Allmänna uppgifter

0.1 Ämnesområde

Ämnesområde:

Finansmarknad

0.2 Statistikområde

Statistikområde:

Övrigt

0.3 SOS-klassificering

Tillhör (SOS)

Nej

0.4 Statistikansvarig

Myndighet/organisation:

Sveriges riksbank

Postadress:

103 37 Stockholm

Besöksadress:

Kontaktperson:

Jyry Hokkanen

Telefon:

08-787 00 00

Telefax:

08-21 05 31

E-post:

jyry.hokkanen@riksbank.se

0.5 Statistikproducent

Myndighet/organisation:

Statistiska centralbyrån

Postadress:

Box 24 300

104 51 Stockholm

Besöksadress:

Kontaktperson:

Jon Smedsaas

Telefon:

08-506 947 08

Telefax:

08-661 52 61

E-post:

jon.smedsaas@scb.se

0.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftslämnarplikt föreligger med stöd av lagen om Sveriges riksbank (1988:1385) 6 kap. 9 §. Mer information finns också i Riksbankens författnings-samling (RBFS 2012:1).

Uppgifter som samlas in från emittenter regleras av Riksbankslagen varvid vite kan utdömas vid sen eller oriktig rapportering.

0.7 Sekretess och regler för behandling av personuppgifter

I myndigheternas särskilda verksamhet för framställning av statistik gäller sekretess enligt 24 kap. 8 § offentlighets- och sekretesslagen (2009:400). Vid automatiserad behandling av personuppgifter gäller reglerna i personuppgiftslagen (1998:204). På statistikområdet finns dessutom särskilda regler för personuppgiftsbehandling i lagen (2001:99) och förordningen (2001:100) om den officiella statistiken.

0.8 Gallringsföreskrifter

Riksbanken är arkivansvarig myndighet enligt arkivlagen. SCB ska förbereda materialet i fråga för arkivering enligt Riksbankens specifikationer och ska årligen överlämna till Riksbanken det material som ska arkiveras.

0.9 EU-reglering

Nej

0.10 Syfte och historik

För utövandet av uppgifterna inom penningpolitik och finansiell stabilitet är det viktigt att Riksbanken kan följa utvecklingen på kreditmarknaderna. Under finanskrisen hösten 2008 framkom stora brister i den statistik över värdepappersmarknader som Riksbanken förfogade över. För att kunna följa utvecklingen på kreditmarknaderna krävs statistik som visar hur t.ex. bankers och företags marknadsfinansiering utvecklas och på vilka villkor den sker. Detta gäller särskilt i orostider när det råder tveksamheter om hur väl marknaderna fungerar. Offentligt tillgänglig statistik är också till fördel för marknadens aktörer.

Första publiceringen genomfördes i april 2013 med mars 2013 som referensperiod. Sedan dess har insamlingen anpassats till att bland annat kunna ta emot information om värdepapper med andra identifikationstyper än ISIN-koder.

0.11 Statistikanvändning

Statistiken utgör underlag för finansräkenskaperna, finansmarknadsstatistiken och betalningsbalansen på SCB samt för Riksbankens beräkningar.

0.12 Uppläggning och genomförande

Undersökningen delas upp i två delar. En registerinsamling och en direktinsamling som till viss del överlappar. Sammantaget är målet för

undersökningen att fånga upp alla värdepapper som emitteras av svenska företag, både i Sverige och utomlands, under en given tidsperiod och därför får objektet värdepapper definiera målpopulationen. I direktinsamlingen används utlandsemitterande företag som undersökningsobjekt. För att få reda på vilka företag som emitterar värdepapper (rampopulationen) används information från Golden Copy som är ett utdrag från ECB:s databas över värdepapper. Undersökningen genomförs månatligen med den sista dagen i månaden som referensdag.

0.13 Internationell rapportering

Nej, statistiken rapporteras inte internationellt.

0.14 Planerade förändringar i kommande undersökningar

Inga förändringar är planerade i kommande undersökningar.

1 Översikt

1.1 Observationsstorheter

Till varje emitterat värdepapper kopplas ett antal egenskaper (eller variabler) där några kan betraktas som bakgrundsvariabler.

<i>Variabler</i>	
Denomineringsvaluta	Organisationsnummer
Emissionsdatum	Poststorlek
Emissionspris	Pris
Emissionsprogrammets volym	Prisdatum
Emittentens hemvist	Rating
Emittentnamn	Referensdatum
ESA95 Sektor	Reposition
Fast kupongränta	Räntebas
Förfalldatum	SecurityType
Förfallopris	Senaste förändringsdatum
Förfallovaluta	Senaste kupongdatum
Första räntedag	Senaste kupongfrekvens
Identifikator	Senaste kupongränta
Identifikatortyp	Säkerhetstyp
Kupongreferensränta	Underliggande säkerhet
Kupongreferensräntepåslag	Utestående belopp
Kupongtyp	Utestående belopp Emittent
Kupongvaluta	Utestående belopp Euroclear
Kvoteringsbas	VP-info
MFI-kod	Värdepapperssort
Månatligt genomsnittspris	Värdepapperstyp
Nace sektor	Värderingsprincip

1.2 Statistiska målstorheter

Utifrån de uppgifter som samlas in skattas och redovisas ett antal totaler (summeringar) och procent.

Statistisk storhet	Parametern tid	Objekt mängd		Variabel	Mått
		Population	Redovisningsgrupper		
Totalt utestående emitterat belopp av i Sverige registrerade företag vid månadsslut efter sektor, valutatyp och förfallotid	Månad	Värdepapper emitterande av företag registrerade i Sverige vid månadsslut	Sektor, valutatyp och förfallotid	Emitterat belopp (mdkr)	Summa
Under månaden emitterat belopp av i Sverige registrerade företag vid månadsslut efter sektor, valutatyp och förfallotid	Månad	Värdepapper emitterande av företag registrerade i Sverige vid månadsslut	Sektor, valutatyp och förfallotid	Emitterat belopp (mdkr)	Summa
Räntekostnad på under månaden emitterat belopp av i Sverige registrerade företag vid månadsslut efter sektor och valutatyp.	Månad	Värdepapper emitterande av företag registrerade i Sverige vid månadsslut	Sektor, valutatyp och förfallotid	Räntekostnad	Procent

1.3 Utförden: statistik och mikrodata

Observationsregister/Mikrodata

All indata lagras elektroniskt och versionshanteras för spårbarhet. I samband med varje publicering låses mikrodata så att den inte går att ändra.

Statistiknyhet

Publiceras 09.30 på SCB:s webbplats den 12:e bankdagen efter referensmånadens utgång.

Statistikdatabasen

I Statistikdatabasen publiceras sammanställningar i form av tabeller den 12:e bankdagen efter referensmånadens utgång. Utdrag av data kan göras för olika variabler efter önskade indelningar och perioder. Statistiken kan väljas att visas på skärmen alternativt laddas ned. Statistikdatabasen innehåller tabeller för de statistiska målstorheter som specificeras i avsnitt 1.2.

Leveranser till externa och interna användare

Förutom publicering används data för leveranser till olika interna användare inom SCB, främst Finansmarknadsstatistiken, Betalningsbalansen och Finansräkenskaperna.

Ett komplett uttag av svenska värdepapper skickas en gång i månaden till Europeiska Centralbanken, ECB, för användning i deras

värdepappersdatabas, CSDB. Användningen består främst i att rätta upp felaktiga karaktäristika för de värdepapper som emitterats av svensk emittent.

Riksbanken har tillgång till data i värdepappersdatabasen via ett webbgränssnitt.

1.4 Dokumentation och metadata

Framtagandet och designen av Värdepappersstatistiken finns dokumenterad enligt SCBDOK (detta dokument) och dess kvalitet finns sammanfattad i dokumentet Beskrivning av statistiken. En mer detaljerad innehållsbeskrivning finns i det som kallas för MetaPlus. Samtliga dokumentationer finns tillgängliga på www.scb.se.

2 Uppgiftsinsamling

2.1 Ram och ramförfarande

Undersökningen samlar in uppgifter om värdepapper från tre register; Euroclear, Golden Copy och Morningstar samt genom direktinsamling från emittenterna. Registren och direktinsamlingen är delvis överlappande men innehåller även var för sig unik information.

Euroclear består av alla, i Sverige, emitterade värdepapper med svensk ISIN-kod. Täckningen i Euroclear är därför mycket god.

Golden Copy är ett månatligt utdrag från Europeiska centralbankens värdepappersdatabas Centralised securities database (CSDB). Täckningen i CSDB är mycket god. CSDB avser täcka samtliga värdepapper emitterade av EU-medborgare, samt värdepapper som är emitterade av icke-EU medborgare inom EU. CSDB väger samman information från ett antal kommersiella dataleverantörer.

Vad gäller direktinsamlingen skapas ramen utifrån uppgifter från Golden Copy. Emittenter som har emitterat mer än tre värdepapper eller till ett belopp överstigande tre miljarder kronor i utländsk valuta. Ett företag fortsätter att lämna uppgifter om ett emitterat värdepapper fram tills värdepapprets förfallodag. Handläggare som jobbar med undersökningen stämmer regelbundet av Golden Copy mot kriterierna för direktinsamlingen.

Uppgifter om företaget, så som telefonnummer, adress och sektorkod, hålls lagrade i undersökningens databas. Emittenter som har emitterat något företag som inte finns i databasen ett värdepapper fångas det automatiskt upp genom att kontroller görs mot Företagsdatabasen. Utöver de automatiska kontrollerna görs även regelbundna avstämningar mot SCB:s företagsdatabas (FDB) för att hålla uppgifterna aktuella. Information om ändrade uppgifter erhålls även direkt från företagets kontaktpersoner i samband med insamlingen av data. Handläggarna som jobbar med undersökningen gör före en ändring av en uppgift en bedömning av riktighet i den nya uppgiften och dess eventuella effekt på undersökningens resultat.

Som ytterligare komplettering av ramen sker en bevakning av massmedia för att på så sätt få reda på om företag emitterat ett värdepapper.

Risk för undertäckning föreligger om ett värdepapper emitteras i utlandet och inte förekommer i Golden Copy eller direktinsamlingen. Risk för

övertäckning föreligger om en uppgiftslämnare lämnar en felaktig ISIN-kod som inte finns i någon annan källa. Handläggare genomför därför regelbundna kontroller av värdepapper som bara har en källa.

2.2 Urvalsförfarande

Undersökningen är en totalundersökning vilket gör att ingen urvalsosäkerhet förekommer. Ambitionen är att samla in alla räntebärande värdepapper som emitterats av svensk emittent. Med svensk emittent avses företag, organisationer eller annan juridisk enhet registrerad i Sverige som emitterar räntebärande värdepapper i Sverige eller utlandet. Av praktiska skäl finns det en cut-off för direktinsamlingen där uppgiftslämnaren dels måste emittera värdepapper i utlandet samt att dessa måste vara minst tre till antalet eller ha ett sammanlagt värde på minst 5 miljarder kronor för att kvalificera sig för direktinsamling. Då emittenter kan tillkomma och falla bort under ett kalenderår kan antalet institut variera mellan olika rapportperioder.

De värdepapper som ej rapporteras i direktinsamlingen fångas upp via registerinsamlingen.

2.3 Mätinstrument

Statistiken bygger i huvudsak på data från externa register hos Euroclear och Morningstar, men även på information som skickas från ECB samt uppgifter från direktinsamling från emittenterna själva. Mätinstrumentet finns återgivet i Bilaga 1 Frågeformulär. Hur uppgifter till de externa registren inhämtas finns beskrivna i länkarna nedan.

Euroclear

http://www.ncsd.eu/1506_SVE_ST.htm

Morningstar

<https://www.navcenter.se/login.aspx>

Direktinsamling

Mätinstrumentet i direktinsamlingen är en xml-fil som innehåller följande variabler och format:

Variabel	Giltiga värden	Tecken
Identifikator	String	15
IdentifikatorTyp	ISIN, CUSIP, SEDOL, OTHER	
NominalCurrency	Currency code (ISO 4217)	3
AmountOutstanding	Numbers	15
AccrualStartDate	YYYY-MM-DD	10
IssueDate	YYYY-MM-DD	10
IssuePrice	Numbers	max 15
MaturityDate	YYYY-MM-DD	10
CouponType	Coupon types	3
LastCouponFrequency	Coupon frequencies	2
FixedCouponRate	Numbers	6 (tex: 1,1651)
CouponRateBase	Referensräntor (tex Realränta=real rate of interest, Stibor 1M, Stibor 3M, Stibor 6M, Stibor 9M, Stibor 12M, Euribor 1M, Euribor 3M, Euribor 6M, Euribor 12M, Libor 1M, Libor 3M, Libor 6M and Libor 12M.)	max 30
CouponRateBaseMargin	Numbers	max 9
Räntebas	30/360, Actual/360, Actual/365, Actual/actual	
DebtType	D.11, D.12X, D.13X, D.141, D.149, D.15, D.161, D.162, D.16X, D.1811, D.1812, D.1819, D.182X, D.19, D.21, D.22, D.231, D.239, D.24, D.29, D.31, D.39	
CollateralType	COV, SNR, SUB och GOV	
Poststorlek	Numbers	15

Repor	Numbers	15
-------	---------	----

2.4 Insamlingsförfarande

Direktinsamling

Minst en person på varje emitterande företag har, genom inloggningsuppgifter (användarnamn och lösenord), tillgång till uppgiftslämnarhemsidan. Uppgiftslämnaren skapar en xml-fil (se avsnitt ovan). Detta görs endera genom att företaget fyller i en Excelfil eller genom ett annat verktyg. Uppgiftslämnaren loggar in på en uppgiftslämnarsida på www.scb.se/svdb, laddar upp filen och skickar sedan iväg den. Efter det att uppgiftslämnaren skickat iväg filen sker två typer av kontroller innan filen läses in i databasen. Upptäcks något i kontrollen får uppgiftslämnaren ett meddelande om det och måste korrigera uppgifterna för att sedan göra ett nytt försök att skicka in uppgifterna. De kontroller som görs listas i valideringstabellen nedan. För formatet på variablerna, se variabellistan i 2.3.

Validering

Variabel	Kontroll
NominalCurrency	Ska vara samma som föregående månad (för samma ISIN)
AmountOutstanding	Belopp >0 får ej existera om MaturityDate är tidigare än ExtractionDate.
AmountOutstanding	Måste vara lika med eller större än Repor.
AccrualStartDate	Får ej vara större än ExtractionDate
IssueDate	Får ej vara större än ExtractionDate
MaturityDate	Ska vara samma som föregående månad.
MaturityDate	Datumet ska vara senare än IssueDate.
CouponType	Ska vara samma som föregående månad
LastCouponFrequency	Ska vara samma som föregående månad
FixedCouponRate	Om CouponType = ZER ska den vara null.
FixedCouponRate	Ska vara samma som föregående månad
CouponRateBase	Ska vara samma som föregående månad
CouponRateBase	Om CouponType = ZER ska den vara null.
CouponRateBaseMargin	Ska vara samma som föregående månad
CouponRateBaseMargin	Om CouponType = ZER ska den vara null.

Räntebas	Ska vara samma som föregående månad
----------	-------------------------------------

Påminnelsearbete

Vid händelse av bortfall påminns uppgiftslämnaren, via e-post eller telefon, av handläggare på SCB. Om dessa påtryckningar inte resulterar i att datauppgifter skickas in kan vitesföreläggande blir aktuellt.

Euroclear

Produkterna nedan hämtas med hjälp av en FTP-tjänst från Euroclear den fjärde bankdagen varje månad.

Produktnamn	Filnamn
Paidsubscriptionshare	S1PAIDSS
Paidsubscriptionunit	S1PAIDSU
Convertibleloan	S2CONDEB
Convertibleparticipatingdebenture(CPD)	S2CONPAR
Discountnote	S2DISCNO
Interest-bearingloan	S2INTBEA
Reverseconvertibleloan	S2REVCON
Interimshare	S3INTSHA
Share	S3SHARE
SwedishDepositoryReceipt	S3DEPREC
Basketcertificate	S4SHBACE
Calloption	S4CALLOP
Equity-linkedbond	S4EQLINO
Fundunit	S4FUNDUN
Subscriptionoption	S4SUBOPT
Warrant	S4WARR
Premiumlotterybond	S5PRLOBO
Non-affiliatedsecurities	SNANONAS
Rightsissue	CA1RIGIS
Unitissue	CA1UNIT
Amortisation	CA2AMORT

Exercisewarrants	CA2REDWA
Interestpayment	CA2INPAY
Otherpayments	CA2OTPAY
Redemption	CA2REDEM
Cashdividend	CA3CASHD
Bonusissue	CA4BONIS
Redemptionsharecapital	CA4REDCA
Reversedsplit	CA4REVSP
Split	CA4SPLIT
Lotterydrawforpremiumbond	CA5ORPLB

För ytterligare information om respektive produkt se:

http://www.ncsd.eu/1597_SVE_ST.htm och

http://www.ncsd.eu/581_SVE_ST.htm

Morningstar

Hämtas via en FTP-tjänst som en gång per månad hämtar alla fonder som har en svensk ISIN-kod. Filen innehåller följande variabler:

ShareID
InsertedDate
ISINCode
ExtractionDate
CategoryID
CategoryName
IssuerDomicileCountry
FundAssetStructureType
FundType
IssueCurrency
IssueDate
IssuePrice
DividentAmount
DividendCurrency
DividendSettlementDate
PriceDate
PriceCurrency
PriceValue
IssuerName
MonthlyReturn
NominalCurrency
IssuerOrganisationCode
MarketCapitalisation

Golden Copy - Europeiska centralbanken

På Europeiska centralbanken (ECB) i Frankfurt samlas information om alla värdepapper emitterade av europeiska företag. Den sjätte bankdagen varje månad skickar ECB, till varje lands respektive centralbank, en samling filer som tillsammans har benämningen Golden Copy. Dessa filer skickas sedan, via en VPN-tunnel, vidare till SCB.

Företagsdatabasen

För klassificering och hjälp vid beräkning av variabler hämtas även uppgifter från SCB:s företagsdatabas (FDB). För varje emitterande företag hämtas följande uppgifter:

- Sektor
- Bransch
- Juridisk form
- Adress
- Ägare
- Antal anställda
- Omsättning

Ecwin

Växelkurser och referensräntor som ingår i beräkningar.

Imputeringar

Om bortfall i direktrapporteringen (d.v.s. av emittenterna), trots ovanstående påminnelsearbete, uppstår finns det metoder för att kompensera för det. Objektsbortfall förekommer i princip inte utan ska i så fall betraktas som undertäckning.

Dock förekommer partiella bortfall inom vissa variabler. Uppgifterna från de olika källorna överlappar varandra. I de fall uppgifterna är motstridiga väljs en uppgift enligt rangordningssystemet nedan, där 1. innebär mest trovärdig.

1. Emittenten
2. Euroclear
3. ECB:s Golden Copy

De regler och beräkningar som gäller för imputeringar av partiella bortfall är:

Variabel	
Pris	För varje förfallotidsintervall och sektor imputeras respektive genomsnittligt marknadspris.

Emissionspris	För varje förfallotidsintervall och sektor imputeras respektive genomsnittligt emissionspris.
---------------	---

2.5 Databeredning

Data granskas på mikronivå i fyra olika steg.

I första läget granskas uppgifterna från direktinsamlingen. De format och valideringskontroller som görs i samband med att uppgiftslämnaren skickar in filen upprepas för att säkerställa att inga felaktiga format och ogiltiga värden förekommer.

När data från alla källor sammanförts görs en granskning mellan källorna samt en tidsseriegranskning av attributen. Det som kontrolleras i det steget är att uppgifter från olika källor som definitionsmässigt ska vara lika, också är det samt värden som är misstänkt avvikande jämfört med tidigare perioder.

Om fel, eller misstänkta fel, signaleras av produktionssystemet får objektet en status som beskriver det misstänkta felet. De misstänkta felen delas upp i kritiska och icke-kritiska fel beroende på vilken inverkan felen kommer att ha på den slutgiltiga publikationen. Även värdepapper som enbart har en källa som grund finns som feltyp. Handläggare kan filtrera och sortera mikrodata efter feltyp, tidseriegranska enskilda attribut eller jämföra källorna till enskilda värdepapper mot varandra. Därefter fattar handläggare beslut om åtgärd.

Attribut	Granskningsregel	Typ av fel
AccrualStartDate	Lika med eller tidigare än <i>Issuedate</i> första gången värdepappret emitteras om det inträffar under referensperiod.	Icke-kritiskt
AccrualStartDate	Om ISIN börjar på SE ska <i>AccrualStartDate</i> vara lika stort som <i>AccrualStartDate</i> i EC	Icke-kritiskt
AccrualStartDate	Om ISIN inte börjar på SE ska <i>AccrualStartDate</i> vara lika stort som <i>AccrualStartDate</i> i GC	Icke-kritiskt
AccrualStartDate	$AccrualStartDate\ t = AccrualStartDate\ t-1$	Kritiskt
AmountOutstanding	Inte vara större än 2x föregående månads rapporterade <i>AmountOutstanding</i> .	Kritiskt
AmountOutstanding	Ska vara lika med eller större än <i>AmountOutstanding</i> från EC på motsvarande <i>ISINCode</i> . (Detta bör gälla: $AmountOutstanding + Repor = AmountOutstanding\ från\ EC$)	Kritiskt

AmountOutstanding	Om ISIN-kod inte funnits tidigare och AmountOutstanding är >5 Mdkr	Kritiskt
AmountOutstanding	Om ISIN börjar på SE ska AmountOutstanding - Repor vara lika stort som AmountOutstanding i EC	Kritiskt
AmountOutstanding	Om ISIN inte börjar på SE ska AmountOutstanding vara lika stort som AmountOutstanding i GC	Kritiskt
CollateralType	Om CollateralType är Gov	Icke-kritiskt
CollateralType	CollateralType t = CollateralType t-1	Kritiskt
CouponRateBase	CouponRateBase t = CouponRateBase t-1	Kritiskt
CouponRateBase	Om ISIN börjar på SE ska CouponRateBase vara lika med CouponRateBase i EC	Icke-kritiskt
CouponRateBaseMargin	CouponRateBaseMargin t = CouponRateBaseMargin t-1	Kritiskt
CouponRateBaseMargin	Om ISIN börjar på SE ska CouponRateBaseMargin vara lika med CouponRateBaseMargin i EC	Icke-kritiskt
CouponRateBaseMargin (Spread)	Om CouponType är FLO = CouponRateBaseMargin ska ligga i intervallet 0-10. Om annan CouponType behöver det inte vara något värde angivet.	Kritiskt
CouponType	Om ISIN börjar på SE ska CouponType vara lika med CouponType i EC	Icke-kritiskt
CouponType	Om ISIN inte börjar på SE ska CouponType vara lika med CouponType i GC	Icke-kritiskt
CouponType	CouponType t = CouponType t-1	Kritiskt
DayCountConvention	DayCountConvention t = DayCountConvention t-1	Kritiskt
DebtType	Om ISIN börjar på SE ska DebtType vara lika med DebtType i GC	Icke-kritiskt
DebtType	DebtType t = DebtType t-1	Kritiskt
FixedCouponRate	Om CouponType = FIX eller STE ska denna anta ett värde. Ska vara i intervallet 0-15	Kritiskt
FixedCouponRate	Om ISIN börjar på SE ska FixedCouponRate vara lika med FixedCouponRate i EC	Icke-kritiskt
FixedCouponRate	Om ISIN inte börjar på SE ska FixedCouponRate vara lika med FixedCouponRate i GC	Icke-kritiskt
FixedCouponRate	FixedCouponRate t = FixedCouponRate t-1	Kritiskt
FixedCouponRate	FixedCouponRate t = FixedCouponRate t-1	Kritiskt
ISINCode	Jämförs mot SVDB så att ingen annan har rapporterat samma ISIN någon gång tidigare i SVDB.	Kritiskt
ISINCode	Övriga källor har ISIN som inte finns i emittentblankett	Kritiskt
ISINCode	Blankett har ISIN som inte finns i andra källor.	Kritiskt

ISINCode	ISIN kod finns bara i en källa	Kritiskt
IssueDate	Om ISIN börjar på SE ska IssueDate vara lika stort som IssueDate i EC	Kritiskt
IssueDate	Om ISIN inte börjar på SE ska IssueDate vara lika stort som IssueDate i GC	Kritiskt
IssueDate	IssueDate t = IssueDate t-1	Icke-kritiskt
IssuePrice	Värdet ska ligga i spannet 80-120. Undantag om kupongtyp är ZC, denna ska vara i spannet 20-100.	Kritiskt
IssuePrice	Ska inte diffa mer än 15 mot tidigare rapporterade IssuePrice (om detta har annat datum, annars ska det vara samma)	Kritiskt
IssuePrice	Om ISIN börjar på SE ska IssuePrice vara lika stort som IssuePrice i EC	Icke-kritiskt
IssuePrice	Om ISIN inte börjar på SE ska IssuePrice vara lika stort som IssuePrice i GC	Icke-kritiskt
IssuePrice	IssuePrice t = IssuePrice t-1	Icke-kritiskt
LastCouponFrequency	Om ISIN börjar på SE ska LastCouponFrequency vara lika med LastCouponFrequency i EC	Icke-kritiskt
LastCouponFrequency	Om ISIN inte börjar på SE ska LastCouponFrequency vara lika med LastCouponFrequency i GC	Icke-kritiskt
LastCouponFrequency	LastCouponFrequency t = LastCouponFrequency t-1	Icke-kritiskt
MaturityDate	Datum får ej ligga mer än 40 år framåt i tiden.	Kritiskt
MaturityDate	Om värdepappret har kupong (om det finns värden i något av FixedCouponRate, CouponRateBase och CouponRateBaseMargin) ska datumet vara minst ett år framåt i tiden.	Icke-kritiskt
MaturityDate	Om ISIN börjar på SE ska MaturityDate vara lika stort som MaturityDate i EC	Icke-kritiskt
MaturityDate	Om ISIN inte börjar på SE ska MaturityDate vara lika stort som MaturityDate i GC	Icke-kritiskt
MaturityDate	MaturityDate t = MaturityDate t-1	Kritiskt
NominalCurrency	Om ISIN börjar på SE ska NominalCurrency vara samma som i EC	Kritiskt
NominalCurrency	Om ISIN inte börjar på SE ska NominalCurrency vara samma som i GC.	Kritiskt
NominalCurrency	NominalCurrency t = NominalCurrency t-1	Kritiskt
Räntebas	Om ISIN börjar på SE ska Räntebas vara lika med Räntebas i EC	Icke-kritiskt

Beräkning/härledning

Efter att de olika datakällorna har slagit samman genomförs beräkningar av variabler. SVDB innehåller följande beräknade variabler:

Variabel	Definition
Marknadsvärde	Utestående nominellt belopp till marknadsvärde
Total kupongbetalning	Det totala belopp nominellt som utbetalas vid kupongförfall
Total utdelning	Det totala belopp som utbetalas vid utdelning
Transaktion marknadsvärderad	Periodens transaktion nominellt till marknadsvärde, inklusive emissioner, förtida inlösen, återköp och förfall.
Emitterat belopp, brutto	Belopp emitterat under perioden
Transaktion nominellt, netto	Periodens transaktion nominellt, inklusive emissioner, förtida inlösen, återköp och förfall.
Upplupen ränta emittent	Periodens upplupna ränta nominellt beräknat från Yield to maturity Debtor och utestående belopp
Upplupen ränta innehavare	Periodens upplupna ränta nominellt beräknat från Yield to maturity creditor och utestående belopp
Utestående belopp i SEK	Nominellt utestående belopp omräknat till kronor
Yield to maturity Creditor	Periodens avkastning beräknat från marknadspris
Yield to maturity Debtor	Periodens avkastning beräknat från emissionspris
Återstående löptid	Återstående dagar till förfall från aktuell period till förfalldatum

I detta läge består SVDB av ett så komplett och korrekt observationsregister som, i den enskilda stunden, är möjligt.

3 Statistisk bearbetning och redovisning

Utifrån den använda definitionen på värdepapper antas SVDB innehålla uppgifter om alla värdepapper. Därför görs inga justeringar (t.ex.

korrigeringar med hjälp av uppräkningsstal) av mikrodata innan skattningar beräknas.

3.1 Skattningar: antaganden och beräkningsformler

Summering av uppgifter från institutnivå till redovisningsgrupper.

Aggregeringar sker på utestående belopp, transaktioner och avkastning. De aggregeringar som sker på utestående belopp och transaktioner summeras med interna vikter per sektor, löptid och valutaslag.

Avkastningen aggregeras per sektor, löptid och valutaslag och viktas enskilt från utestående belopp i förhållande till totalt utestående belopp i respektive redovisningsgrupp.

3.2 Redovisningsförfaranden

Emissioner av räntebärande värdepapper följer publiceringskalendern för Sveriges officiella statistik. Statistiken publiceras den 12:e bankdagen varje månad kl. 09.30 på SCB:s webbplats www.scb.se.

På webbplatsen publiceras statistiknyheter som innehåller analyser av statistiken. Det finns även möjlighet att göra egna uttag från Statistikdatabasen.

Frågor kan skickas via e-post till direkt till SVDB-gruppen: SVDB@scb.se. Det går också bra att vända sig till SCB:s centrala Statistikservice: <http://www.scb.se/kontakt> .

Varje månad skickas en kopia av SVDB till ECB i Frankfurt, där den sammanförs med övriga värdepapper från andra Europeiska länder i Centralised securities database, CSDB.

Primäruppgifter är skyddade av sekretesslagen, se punkt 0.7. Sekretess och regler för behandling av personuppgifter. Vissa specialbearbetningar kan göras av SCB på beställning mot ersättning enligt fastställd taxa.

4 Slutliga observationsregister

4.1 Produktionsversioner

I det här dokumentet (SCBDOK) har framtagningen av nedanstående slutliga observationsregister beskrivits.

Register	Värdepappersstatistik
Registervariant	Räntebärande
Registerversion	2016

Fortsatt dokumentation, av registrens detaljerade innehåll, finns på SCB:s webbplats. Där beskrivs alla variabler och värdemängder m.m. Dokumentationen hittar du här: www.metadata.scb.se. Klicka dig fram med hjälp av namnen på Register, Registervariant och Registerversion som är angivna i ovanstående tabell.

4.2 Arkiveringsversioner

Inga registerversioner har ännu arkiverats.

4.3 Erfarenheter från senaste undersökningsomgången

Inga särskilda erfarenheter finns från denna undersökningsomgång. Arbetet har gått helt enligt plan.

