

# Värdepappersstatistik SVDB

## 2013

### FM9998

## Innehåll

<b>0</b>	<b>Allmänna uppgifter .....</b>	<b>2</b>
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 .....	4
0.12	Uppläggning och genomförande .....	4
0.13	Internationell rapportering .....	4
0.14	Planerade förändringar i kommande undersökningar .....	4
<b>1</b>	<b>Översikt .....</b>	<b>5</b>
1.1	Observationsstorheter .....	5
1.2	Statistiska målstorheter .....	6
1.3	Utflöden: statistik och mikrodata .....	6
1.4	Dokumentation och metadata .....	7
<b>2</b>	<b>Uppgiftsinsamling .....</b>	<b>8</b>
2.1	Ram och ramförfarande .....	8
2.2	Urvalsförfarande .....	9
2.3	Mätinstrument .....	9
2.4	Insamlingsförfarande .....	13
2.5	Databeredning .....	17
<b>3</b>	<b>Statistisk bearbetning och redovisning .....</b>	<b>22</b>
3.1	Skattningar: antaganden och beräkningsformler .....	22
3.2	Redovisningsförfaranden .....	22
<b>4</b>	<b>Slutliga observationsregister .....</b>	<b>23</b>
4.1	Produktionsversioner .....	23
4.2	Arkiveringsversioner .....	23
4.3	Erfarenheter från senaste undersökningsomgången .....	23

## 0 Allmänna uppgifter

### 0.1 Ämnesområde

Ämnesområde:

Finansmarknad

### 0.2 Statistikområde

Statistikområde:

Övrigt

### 0.3 SOS-klassificering

Tillhör (SOS)

Nej



För undersökningar som ingår i Sveriges officiella statistik gäller särskilda regler när det gäller kvalitet och tillgänglighet, se Förordningen om den officiella statistiken (2001:100).

### 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: fornamn.efternamn@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: fornamn.efternamn@scb.se

### 0.6 Uppgiftsskyldighet

Ja, uppgiftsskyldighet föreligger enligt Lagen (1988:1385) om Sveriges riksbank  
kap 6: § 9

Nej, uppgiftsskyldighet föreligger inte enligt lagen om den officiella statistiken (SFS 2001: 99).

### **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).

Inga personuppgifter förekommer i Värdepappersstatistik SVDB.

### **0.8 Gallringsföreskrifter**

Riksbanken är arkivansvarig myndighet enligt arkivlagen för de handlingar och statistiska uppgifter som upprättas och samlas in av SCB för Riksbankens räkning. SCB förbereder för arkivering och överlämnar till Riksbanken grunddata och andra register, inklusive gamla versioner, samt standardiserade leveransvariabler/leveranser som ska arkiveras. Registren och leveransvariablerna bevaras digitalt och konverteras av SCB till det format som Riksarkivet fastställt som arkivformat. Inkomna statistiska rapporter, i digital eller pappersform, med primäruppgifter gallras av SCB enligt Riksbankens gallringsbeslut. Publikationer, rapporter och dokumentation av statistiken bevaras digitalt och arkiveras av Riksbanken enligt gällande informationshanteringsplan. Riksbanken diarieför vissa handlingar rörande finansmarknadsstatistiken.

Varje institut som lämnar uppgifter elektroniskt måste spara en undertecknad kopia av rapporten i läsbar form i minst två år efter utgången av den rapportperiod som uppgiften avser. Även kopior av rättelser och andra ändringar av lämnade uppgifter som institutet gör skall undertecknas och sparas i minst två år. Detta i enlighet med Riksbankens föreskrifter och allmänna råd RBFS 2010:1.

Följande handlingar får gallras med den gallringsfrist Statistiska centralbyrån bestämmer:

Inkomna statistiska rapporter, i digital eller pappersform, med primäruppgifter tillhörande värdepappersstatistiken får gallras under förutsättning att innehållet har förts över till SCB:s databas för Värdepappersstatistik och att nödvändig kontroll har skett.

### **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. I specialfall, i situationer där de finansiella institutens finansieringsmöjligheter är ansträngda, kan även daglig insamling ske. 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.

Sammantaget är målet för undersökningen att fånga upp alla värdepapper som emitteras av svenska företag, både i Sverige och utomlands, under en given tidsperiod.

Undersökningen startade under 2013 med mars som första referensmånad.

## 0.11 Statistikanvändning

Användningsområde för statistiken är bland annat:

Underlag till SCB:s finans- och nationalräkenskaper.

Underlag till Finansmarknadsstatistik.

Underlag till Betalningsbalansen.

Underlag till Riksbankens publicering och uppföljning av institutens utveckling.

Underlag till analyser för aktörer på olika marknader inkl. instituten själva

Underlag till Utredare/forskare/studenter, utredningar mm.

## 0.12 Uppläggning och genomförande

På uppdrag av Riksbanken samlar SCB in, bearbetar och publicerar månadsvis värdepappersstatistiken. Insamlingen av data sker med stöd av Lagen (1988:1385) om Sveriges riksbank. Upplägget är en totalundersökning av alla svenska institutioner som emitterar räntebärande värdepapper. Källorna till statistiken är direktinsamling via enkät från emittenter och registerdata från Eurclear, Europeiska centralbanken och företagsdatabasen.

Direktinsamlingen omfattar institut som ger ut värdepapper utanför Sverige. Avgränsningen sker för att registerdata från Euroclear bedöms ha tillfredställande kvalitet avseende värdepapper utgivna i Sverige.

## 0.13 Internationell rapportering

Enligt avtal levererar SCB uppgifter om svenska värdepapper till Europeiska centralbanken (ECB) via Riksbanken. Leveranser av kommaseparerade filer sker månadsvis via STAR-systemet. 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.

## 0.14 Planerade förändringar i kommande undersökningar

Sektorkoderna kommer att förändras i och med implementering av INSEKT2014 under kvartal 4 2014.

# 1 Översikt

Statistiken beskriver värdepapper och deras egenskaper, såsom utestående belopp, denomineringsvaluta, emittent och löptid, och därför får objektet värdepapper definiera målpopulationen. Statistiken samlas in månatligen och publicerar totalt utestående emitterat belopp, under månaden emitterat belopp och räntekostnad. Publicering sker den 12:e bankdagen.

## 1.1 Observationsstorheter

Till varje emitterat värdepapper kopplas ett antal egenskaper.

<i>Observationsstorheter</i>	
Denomineringsvaluta	Organisationsnummer
Emissionsdatum	Pris
Emissionspris	Prisdatum
Emissionsprogrammets volym	Rating
Emittentens hemvist	Referensdatum
Emittentnamn	Reposition
ESA95 Sektor	Räntebas
Fast kupongränta	SecurityType
Förfalldatum	Senaste förändringsdatum
Förfallopris	Senaste kupongdatum
Förfallovaluta	Senaste kupongfrekvens
Första räntedag	Senaste kupongränta
ISIN-kod	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	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 netto 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 netto (mdkr)	Summa
Under månaden emitterat belopp brutto 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 brutto (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 Utflöden: statistik och mikrodata

### *Observationsregister/Mikrodata*

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

### *Pressmeddelande*

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

### *Statistikdatabas (SSD)*

I Sveriges statistiska databaser (SSD) 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. SSD 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 (BaS). En mer detaljerad innehållsbeskrivning finns i det som kallas för MetaPlus. Samtliga dokumentationer finns tillgängliga på [www.scb.se](http://www.scb.se).

## 2 Uppgiftsinsamling

### 2.1 Ram och ramförfarande

Ambitionen är att samla in alla räntebärande värdepapper som emitterats av svensk emittent. Med svensk emittent avses företag, organisationer eller annan juridisk enhet, institut, med svensk hemvist 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, vilket är om värdepapper utgivna av institut med färre än 3 värdepapper i utländsk valuta eller med ett värde på mindre än 5 miljarder kronor omräknat från utländsk valuta. Denna avgärnsning har skett med hänsyn till uppgiftslämnarbördan och att kvaliteten i registerinformationen är tillräckligt god.

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. ISIN-kod är en internationell identifikator för värdepapper. Täckningen i Euroclear är därför mycket god.

Golden Copy är ett månatligt utdrag från Europeiska centralbankens värdepappersdatabas Centralised securities database (CSDB) som levereras till samtliga centralbanker inom EU den 6:e bankdagen varje månad. 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 fem 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.

Morningstar är en kommersiell leverantör av fondinformation. Från Morningstar erhålls ett månatligt utdrag med information om svenska



investeringsfonder som de har i sitt register. Täckningen i Morningstar bedöms vara god avseende svenska investeringsfonder.

Uppgifter om företaget, så som telefonnummer, adress och sektorkod, hålls lagrade i undersökningens databas. Emitterar 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 företagens 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.

## 2.2 Urvalsförfarande

Undersökningen är en totalundersökning, därför finns inget urvalsförfarande, vilket gör att ingen urvalsosäkerhet förekommer.

## 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. Hur uppgifter till de externa registren inhämtas finns beskrivna i länkarna nedan.

### *Euroclear*

Uppgifter från Euroclear hämtas via FTP-server. FTP är ett filöverföringsprotokoll för överföringar på internet. Datan är i xml-format och uppdelad i olika produkter beroende på vilken typ av värdepapper som informationen avser. För mer information om datatjänsten se Euroclears tekniska information [http://www.ncsd.eu/1506\\_SVE\\_ST.htm](http://www.ncsd.eu/1506_SVE_ST.htm).

### *Morningstar*

Uppgifterna från Morningstar hämtas via FTP-server. Datan är i xml-format. För vidare information se: <https://www.navcenter.se/login.aspx>.

### *Golden Copy*

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. Informationen är kommaseparerad.

*Direktinsamling*

För att rapportera emissioner av räntebärande värdepapper krävs att en fil skapas, i formatet XML och som följer det schema som kan laddas ned från uppgiftslämnarhemsidan efter inloggning. När XML-filen är skapad laddas den upp på en sida som kallas emittentwebben och där sker även en validering av uppgifterna i filen. Ett XML-schema specificerar vilka värden som får förekomma för en viss variabel och filen går inte att ladda upp om uppgifterna i filen bryter mot schemat.

I XML-schemat specificeras vilka värden en variabel kan anta samt vilka format som är giltiga. Vissa variabler har en bestämd uppsättning värden den kan anta medans andra, exempelvis datum, endast kräver ett visst format. Uppgifterna ska vara affärsdagsredovisade och avse ställningen per den sista i varje rapportmånad. Belopp anges i tusental. Rapporteringen av värdepappersemissioner sker elektroniskt via uppladdning av data. Nedan beskrivs giltiga format för de variabler där det ej finns en bestämd uppsättning valida värden:

Variabel	Giltiga värden	Tecken
ISIN	ISIN-number (ISO 6166)	12
Denomineringsvaluta	Currency code (ISO 4217)	3
Utestående belopp	Numbers	15
Första räntedag	YYYY-MM-DD	10
Emissionsdatum	YYYY-MM-DD	10
Emissionspris	Numbers	max 15
Förfalldatum	YYYY-MM-DD	10
Kupongtyp	Coupon types	3
Senast kupongfrekvens	Coupon frequencies	2
Fast kupongränta	Numbers	6 (tex: 1,1651)
Referensränta	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
Räntepåslag	Numbers	max 9
Räntebas	30/360, Actual/360, Actual/365, Actual/actual	
Värdepapperstyp	D.2, D.72, D.742, D.32, D.15, H.3, H.4, D.11, D.9, D.74X och	3

	D.7X	
Säkerhetstyp	COV, SNR, SUB och GOV	
Repor	Numbers	15

**ISIN.** International Securities Identification Number. ISIN är en unik identifierare av värdepapper. Dess struktur är definierad enligt ISO 6166 och ska innehålla 12 stycken tecken.

**Utestående belopp.** Här redovisas värdepapperets utestående belopp vid aktuell rapporteringsmånad. Uppgifterna ska vara affärsdagsredovisade. Beloppet redovisas till nominellt värde i emissionens denomineringsvaluta och anges i tusental. SCB räknar om belopp i utländsk valuta till svenska kronor. Vid eventuella följande skuldförbindelser som ges ut under värdepapperets löptid, on-tap-emissioner, ska nytt utestående belopp efter on-tap-emissionen anges här. Detta nya utestående belopp ska fortsätta rapporteras ända till en ny ”tap” sker.

**Första räntedag.** Den dag då ränta börjar löpa upp. Vid nyemission är det oftast samma dag som emissionsdag. Detta datum är konstant under värdepapperets löptid.

**Emissionsdag.** Den dag som skuldförbindelsen börjar gälla. Vid eventuella följande skuldförbindelser som ges ut under värdepapperets löptid, on-tap-emissioner, anges den nya emissionsdagen för respektive on-tap-emission. Detta datum ska fortsätta rapporteras ända till en ny on-tap sker.

**Emissionspris.** Det genomsnittliga pris som värdepapperet såldes till vid emissionstillfället. Om värdepapperet exempelvis såldes till nominellt värde anges priset till 100.

**Förfallodag.** Den dag då nominellt belopp och eventuell avkastning återbetalas av emittenten. Om förfallodagen inte är känd ska datumet 9999-12-31 anges.

**Kupongfrekvens.** Här anges hur ofta kupongen utbetalas. De kupongfrekvenser som kan anges är:

- Nollkupong
- År
- Halvår
- Kvartal
- Varannan månad
- Månad
- Varannan vecka
- Oregelbunden
- Okänd
- Annan

**Kupongtyp.** Om värdepapperet har kupong anges här vilken typ det avser. När det gäller strukturerade produkter som inte har kupong anges kupongtypen till nollkupong. De kupongtyper som kan anges är:

- Fast
- Stegad
- Rörlig

- Nollkupong
- Index-linked
- Credit-linked
- Annan

**Kupongränta.** Vid fast kupong anges här räntesatsen uttryckt i procent med två decimaler.

**Referensränta.** Vid rörlig kupong anges här den referensränta inkl. löptid som används. Om det saknas relevanta referensräntor, kontakta SCB, som då lägger till de referensräntor ni saknar i listan. De referensräntor som kan anges är:

- STIBOR
- EURIBOR
- BBA LIBOR EUR
- BBA LIBOR USD
- BBA LIBOR GBP
- BBA LIBOR CHF
- BBA LIBOR JPY
- BBA LIBOR CAD
- BBA LIBOR AUD
- BBA LIBOR NZD
- BBA LIBOR DKK
- NIBOR
- KPI

Uppdelade på (gäller inte KPI):

- 1 månad
- 3 månader
- 6 månader
- 9 månader
- 12 månader

**Räntepåslag.** Vid rörlig kupong anges här det påslag (ev. avdrag) i procent på referensräntan som används, det vill säga antalet räntepunkter delat med hundra. Ange avdrag med minustecken.

**Räntebas.** Anger vilken räntekonvention som gäller för respektive värdepapper. De typer av räntebaser som kan anges är:

- 30/360
  - 30E360
  - Actual/360
  - Actual/365
  - Actual/actual

**Denomineringsvaluta.** Här anges vilken valuta värdepapperet är emitterat i. Samtliga valutor som ingår i ISO 4217 kan användas. Om det saknas relevanta valutor, kontakta SCB som då lägger till de valutor ni saknar i listan.

**Värdepapperstyp.** Här anges vilken typ av värdepapper den specifika ISIN-koden avser.

De värdepapperstyper som kan anges är:

- Vanlig obligation
- Evig obligation

- Asset backed security
- Euro medium term note
- Övriga medium term note
- Bankcertifikat
- Euro commercial paper
- Övriga commercial paper
- Övriga penningmarknadsinstrument
- Övrig obligation
- Konvertibelt skuldebrev
- Obligation med warrant
- Övrig strukturerad produkt

**Säkerhetstyp.** Här anges vilken typ av säkerhet värdepapperet är emitterat under, exempelvis statlig garanti eller säkerställd obligation. De säkerhetstyper som kan anges är:

- Säkerställd
- Senior
- Junior
- Statlig garanti

**Repor.** Här anges det nominella värdet av repor i tusental. Värdet kan vara positivt (omvänd repa) eller negativt (repa). En omvänd repa innebär ett avtal om att emittenten köper egna papper och samtidigt gör en överenskommelse att sälja tillbaka dem efter en fastställd tid, beloppet anges med positivt värde. En repa innebär ett avtal om att emittenten säljer egna värdepapper och samtidigt gör en överenskommelse om återköp efter en fastställd tid, beloppet anges med negativt värde (minustecken).

## 2.4 Insamlingsförfarande

### *Direktinsamling*

Nya uppgiftslämnare kontaktas först via missiv och därefter per mail och per telefon där information om undersökningen delges. 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 Excel-fil eller genom ett annat verktyg. Uppgiftslämnaren loggar in på en uppgiftslämnarsida på [www.scb.se/svdb](http://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.

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.

*Granskningskontroller*

Variabel	Kontroll
Denomineringsvaluta	Ska vara samma som föregående månad (för samma ISIN)
Utestående belopp	Belopp >0 får ej existera om Förfalldatum är tidigare än Referensdatum.
Utestående belopp	Måste vara lika med eller större än Repor.
Första räntedag	Får ej vara större än Referensdatum
Emissionsdatum	Får ej vara större än Referensdatum
Förfalldatum	Ska vara samma som föregående månad.
Förfalldatum	Datomet ska vara senare än Emissionsdatum.
Kupongtyp	Ska vara samma som föregående månad
Senaste kupongfrekvens	Ska vara samma som föregående månad
Fast kupongränta	Om Kupongtyp = ZER ska den vara null.
Fast kupongränta	Ska vara samma som föregående månad
Referensränta	Ska vara samma som föregående månad
Referensränta	Om Kupongtyp = ZER ska den vara null.
Räntepåslag	Ska vara samma som föregående månad
Räntepåslag	Om Kupongtyp = 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 bli aktuellt.

*Euroclear*

Produkterna nedan hämtas med hjälp av en FTP-tjänst från Euroclear den fjärde bankdagen varje månad. FTP är ett filöverföringsprotokoll för överföringar på internet.

En produkt avser en värdepapperstyp.

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](http://www.ncsd.eu/1597_SVE_ST.htm) och

[http://www.ncsd.eu/581\\_SVE\\_ST.htm](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. Växelkurser används för att räkna om belopp i utländska valutor till kronor och referensräntor för att beräkna kupongräntor.

#### *Imputeringar*

Om det uppstår bortfall i direktsamlingen (d.v.s. av emittenterna), trots ovanstående påminnelsearbete, finns det metoder för att kompensera för det. Om en fil inte har inkommit kan information hämtas från andra källor, Euroclear och Golden copy. Det är också möjligt att hämta information om värdepapper från föregående månad för att kompensera för bortfallet.

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
4. Morningstar

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

Variabel	
Pris (Marknadspris)	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 direktsamlingen. 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 variabelvärden. 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 statistikens kvalitet. Även värdepapper som enbart har en källa som grund finns som feltyp. Handläggare kan filtrera och sortera mikrodata efter feltyp, tidseriegranska enskilda variabler eller jämföra källorna till enskilda värdepapper mot varandra. Därefter fattar handläggare beslut om åtgärd.

Observationsstorhet	Granskningsregel	Typ av fel
Första räntdag	Lika med eller tidigare än <i>Emissionsdatum</i> första gången värdepappret emitteras om det inträffar under referensperiod.	Icke-kritiskt
Första räntdag	Om ISIN börjar på SE ska Första räntdag vara lika stort som Första räntdagmed Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Första räntdag	Om ISIN inte börjar på SE ska Första räntdagvara lika stort som Första räntdagmed Golden Copy som indatakälla.	Icke-kritiskt
Första räntdag	Första räntdag = Första räntdag-1	Kritiskt
Utestående belopp	Inte vara större än 2x föregående månads rapporterade Utestående belopp.	Kritiskt
Utestående belopp	Ska vara lika med eller större än <i>Utestående belopp från Euroclear som indatakälla från EC på motsvarande ISIN.</i> (Detta bör gälla: Utestående belopp+Repor = Utestående beloppfrån Euroclear som indatakälla.)	Kritiskt
Utestående belopp	Om ISIN-kod inte funnits tidigare och Utestående beloppär >5 Mdkr	Kritiskt
Utestående belopp	Om ISIN börjar på SE ska Utestående belopp- Repor vara lika stort som Utestående beloppmed Euroclear som indatakälla.från Euroclear som indatakälla	Kritiskt
Utestående belopp	Om ISIN inte börjar på SE ska Utestående beloppvara lika stort som Utestående belopp med Golden Copy som indatakälla.	Kritiskt
Säkerhetstyp	Om Säkerhetstyp är Gov	Icke-kritiskt
Säkerhetstyp	Säkerhetstyp t = Säkerhetstyp t-1	Kritiskt
Referensränta	Referensräntat = Referensräntat-1	Kritiskt
Referensränta	Om ISIN börjar på SE ska Referensräntavara lika med Referensräntamed Euroclear som indatakälla.som kommer från Euroclear.	Icke-kritiskt
Räntepåslag	Räntepåslag t = Räntepåslag t-1	Kritiskt
Räntepåslag	Om ISIN börjar på SE ska Räntepåslag vara lika med Räntepåslag från Euroclear som indata.med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Räntepåslag	Om Kupongtyp är FLO: Räntepåslag ska ligga i intervallet 0-10. Om annan Kupongtyp behöver det inte vara något värde angivet.	Kritiskt

Kupongtyp	Om ISIN börjar på SE ska Kupongtyp vara lika med Kupongtyp med Euroclear som indatakälla.från Euroclear som indata.	Icke-kritiskt
Kupongtyp	Om ISIN inte börjar på SE ska Kupongtyp vara lika med Kupongtyp med Golden Copy som indatakälla. från Golden Copy som indata.	Icke-kritiskt
Kupongtyp	Kupongtyp t = Kupongtyp t-1	Kritiskt
Räntebas	Räntebas t = Räntebas t-1	Kritiskt
Värdepapperstyp	Om ISIN börjar på SE ska Värdepapperstyp vara lika med Värdepapperstyp med Golden Copy som indatakälla.med Golden Copy som indatakälla.	Icke-kritiskt
Värdepapperstyp	Värdepapperstyp t = Värdepapperstyp t-1	Kritiskt
Fast kupongränta	Om Kupongtyp = FIX eller STE ska denna anta ett värde. Ska vara i intervallet 0-15	Kritiskt
Fast kupongränta	Om ISIN börjar på SE ska Fast kupongränta vara lika med Fast kupongränta med Euroclear som indatakälla med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Fast kupongränta	Om ISIN inte börjar på SE ska Fast kupongränta vara lika med Fast kupongräntamed Golden Copy som indatakälla. med Golden Copy som indatakälla.	Icke-kritiskt
Fast kupongränta	Fast kupongräntat = Fast kupongräntat-1	Kritiskt
ISIN	Jämförs mot SVDB så att ingen annan har rapporterat samma ISIN någon gång tidigare i SVDB.	Kritiskt
ISIN	Övriga källor har ISIN som inte finns i emittentblankett	Kritiskt
ISIN	Blankett har ISIN som inte finns i andra källor.	Kritiskt
ISIN	ISIN finns bara i en källa	Kritiskt
Emissionsdatum	Om ISIN börjar på SE ska Emissionsdatum vara lika stort som med Euroclear som indatakälla. Emissionsdatum med Euroclear som indatakälla.	Kritiskt
Emissionsdatum	Om ISIN inte börjar på SE ska Emissionsdatum vara lika stort som Emissionsdatum med Golden Copy som indatakälla.	Kritiskt
Emissionsdatum	Emissionsdatum t = Emissionsdatum t-1	Icke-kritiskt
Emissionspris	Värdet ska ligga i spannet 80-120. Undantag om kupongtyp är ZC , denna ska vara i spannet 20-100.	Kritiskt
Emissionspris	Ska inte diffa mer än 15 mot tidigare rapporterade Emissionspris (om detta har annat datum, annars ska det vara samma)	Kritiskt

Emissionspris	Om ISIN börjar på SE ska Emissionspris vara lika stort som Emissionspris med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Emissionspris	Om ISIN inte börjar på SE ska Emissionspris vara lika stort som Emissionspris med Golden Copy som indatakälla.	Icke-kritiskt
Emissionspris	$Emissionspris_t = Emissionspris_{t-1}$	Icke-kritiskt
Senaste kupongfrekvens	Om ISIN börjar på SE ska Senaste kupongfrekvens vara lika med Senaste kupongfrekvens med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Senaste kupongfrekvens	Om ISIN inte börjar på SE ska Senaste kupongfrekvens vara lika med Senaste kupongfrekvens med Golden Copy som indatakälla.	Icke-kritiskt
Senaste kupongfrekvens	$Senaste\ kupongfrekvens_t = Senaste\ kupongfrekvens_{t-1}$	Icke-kritiskt
Förfalldatum	Datum får ej ligga mer än 40 år framåt i tiden.	Kritiskt
Förfalldatum	Om värdepappret har kupong (om det finns värden i något av Fast kupongränta, Referensränta och Räntepåslag) ska datumet vara minst ett år framåt i tiden.	Icke-kritiskt
Förfalldatum	Om ISIN börjar på SE ska Förfalldatum vara lika stort som Förfalldatum med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Förfalldatum	Om ISIN inte börjar på SE ska Förfalldatum vara lika stort som Förfalldatum med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt
Förfalldatum	$Förfalldatum_t = Förfalldatum_{t-1}$	Kritiskt
Denomineringsvaluta	Om ISIN börjar på SE ska Denomineringsvaluta vara samma som med Euroclear som indatakälla.	Kritiskt
Denomineringsvaluta	Om ISIN inte börjar på SE ska Denomineringsvaluta vara samma som med Golden Copy som indatakälla..	Kritiskt
Denomineringsvaluta	$Denomineringsvaluta_t = Denomineringsvaluta_{t-1}$	Kritiskt
Räntebas	Om ISIN börjar på SE ska Räntebas vara lika med Räntebas med Euroclear som indatakälla.	Icke-kritiskt

*Beräkning/härledning*

Efter att de olika datakällorna har slagits 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 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 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. Varje enskilt räntebärande värdepapper ger en procentuell avkastning vid respektive emissionstillfälle. Vid aggregering måste varje enskild avkastning viktas efter värdepapprets utestående belopp relativa förhållande mot redovisningsgruppens totala utestående belopp.

#### 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](http://www.scb.se).

På webbplatsen publiceras pressmeddelanden 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](mailto:SVDB@scb.se). Det går också bra att vända sig till SCB:s centrala Statistiks-service: [http://www.scb.se/Pages/Form\\_\\_\\_\\_261499.aspx](http://www.scb.se/Pages/Form____261499.aspx)

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**

Produktversioner är ännu inte dokumenterade.

### **4.2 Arkiveringsversioner**

### **4.3 Erfarenheter från senaste undersökningsomgången**

Information om emissionspriser är bristfälligt i Euroclear och hittas inte alltid i Golden Copy. Därför kan det behöva kompletteras med uppgifter från institut som faller utanför cutoff-gränsen för direktinsamling.

Leveranser av Golden Copy sker sällan på den 6:e bankdagen. Leveranserna av Golden Copy tar ofta tid och kan inkomma upp till tre dagar efter den 6:bankdagen. Tidpunkt för publicering kan behöva diskuteras med uppdragsgivaren.