

Brukerveiledning for aggregerte pengemarkedsdata

Innhold

1. Om datasettene.....	2
2. Kolonnedefinisjoner	3
MM_SEGMENT.....	3
COUNTERPART_TYPE.....	3
TRANSACTION_TYPE.....	3
MATURITY.....	4
FX_CURRENCY	5
COLL_ISSUER_AREA.....	6
COLL_SEC_TYPE.....	7
COL_ISIN	7
RATE_TYPE.....	8
Måleenheter.....	8
3. Eksempler på bruk.....	9
Eksempel 1:	9
Eksempel 2:	9
4. Kjente problemstillinger	10

1. Om datasettene

Dette dokumentet inneholder metadata for aggregerte pengemarkedsdata som publiseres av Norges Bank, samt noen eksempler på filtrering av de publiserte dataene. Tabellene under inneholder navn og beskrivelse på de ulike kolonnene i datasettene. Kolonne-id og verdier i datasettene er gitt ved «Id»-kolonnen i tabellene. Kolonnen «Navn» og «Beskrivelse» gir navn og beskrivelse for hver «Id».

Ikke alle verdier er tilgjengelige for alle kolonner og datasett. For eksempel er kolonnen som spesifiserer valuta kun tilgjengelig for valutabytteavtaler, og kolonnen som referanserente kun tilgjengelig for transaksjoner med flytende rente knyttet til en referanserente. Hvis en rad inneholder verdien «_Z» i en eller flere kolonner betyr det at det ikke er noen tilgjengelig verdi i disse kolonnene for de valgte transaksjonene. For eksempel vil transaksjoner med fastrente kun inneholde verdien «_Z» både i kolonnen som spesifiserer referanserente, og i kolonnen som spesifiserer påslag over referanserente i transaksjonen, ettersom disse kolonnene kun er tilgjengelige for transaksjoner med flytende rente.

Det er mulig å laste ned datasettene med verdiene i Navn-kolonnen i stedet for Id. Dette kan man gjøre ved å kopiere url-lenken til hvert datasett og bytte ut «labels=id» med «labels=name», slik illustrert under:

Datasett for valutabytteavtaler med «Id» som kolonne- og variabelnavn (dette er slik datasettet ser ut på nettsiden):

https://data.norges-bank.no/api/data/NB,MONEY_MARKET,1.0/B.F.....?format=excels&labels=id&locale=no&dimensionAtObservation=UNIT_MEASURE

Bytt ut «labels=id» i url-en med «labels=name» for å få «Navn» som kolonne og variabelnavn:

https://data.norges-bank.no/api/data/NB,MONEY_MARKET,1.0/B.F.....?format=excels&labels=name&locale=no&dimensionAtObservation=UNIT_MEASURE

2. Kolonnedefinisjoner

MM_SEGMENT

Navn: pengemarkedssegment. Spesifiserer hvilket pengemarkedssegment en transaksjon tilhører.

Id	Navn	Beskrivelse
F	Valutabytteavtaler	Valutabytteavtaler
T	Sikret marked	Sikret marked
U	Usikret marked	Usikret marked

COUNTERPART_TYPE

Navn: Motpartstype. Kolonnen spesifiserer typen motpart i en transaksjon. Alle transaksjoner ses fra rapportørbankers ståsted. Transaksjoner merket med «COUNTERPARTY_TYPE» = «RPDAGENT» utgjør transaksjoner mellom rapportørbanker. Transaksjoner merket hhv. «FOREIGN» og «DOMESTIC» består av transaksjoner rapportørbankene gjør mot hhv. utenlandske (ikke-norske) og utenlandske motparter som ikke deltar i Norges Banks pengemarkedsrapportering. Se også kolonne «TRANSACTION_TYPE», under, for hvordan man tar hensyn til dobbelrapportering av transaksjoner av rapportørbankene.

Id	Navn	Beskrivelse
RPDAGENT	Rpd Agent	Annen rapportørbank
FOREIGN	Utenlandsk	Utenlandsk motpart (ikke rapportørbank)
DOMESTIC	Innenlandsk	Innenlandsk motpart (ikke rapportørbank)

TRANSACTION_TYPE

Navn: Transaksjonstype. Spesifiserer type transaksjon. Alle transaksjoner ses fra rapportørbankenes synspunkt, slik at f.eks. transaksjoner merket BO (for innlån) er transaksjoner der rapportørbanker låner inn kroner. Merk at transaksjoner mellom rapportørbanker inngår som både kjøp og salg/innlån og utlån i datasettet. For å unngå dobbelttelling av disse transaksjonene, må man velge kun «Kjøp» eller «Salg» for valutabytteavtaler og kun «Innlån» eller «Utlån» for usikrede og sikrede transaksjoner, når man ser på transaksjoner mellom rapportørbanker. Vær oppmerksom på at det kan oppstå avvik mellom volum mellom rapportørbanker merket som Sell/Buy, eller Borrow/lend på grunn av avvik i rapporteringen fra bankene.

Id	Navn	Beskrivelse
BU	Kjøp	Kjøp av kroner på nærmeste bein i valutabytteavtale

SE	Salg	Salg av kroner på nærmeste bein i valutabytteavtale
BO	Innlån	Innlån av kroner
LE	Utlån	Utlån av kroner

MATURITY

Navn: Løpetid. Spesifiserer løpetidsinndelinger for transaksjoner.

Id	Navn	Beskrivelse
1W	1 uke	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 7-8 kalenderdager
2W	2 uker	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 14-15 kalenderdager
3W	3 uker	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 21-22 kalenderdager
1M	1 måned	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 25-35 kalenderdager
2M	2 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 50-70 kalenderdager
3M	3 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 80-100 kalenderdager
4M	4 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 110-130 kalenderdager
5M	5 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 140-160 kalenderdager
6M	6 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på 170-190 kalenderdager
6MP	Mer enn 6 måneder	Transaksjon med oppgjørsdato ikke mer enn 5 virkedager etter handledato, og løpetid på mer enn 190 kalenderdager
FLL	F+1M+1M	Transaksjon med oppgjør på termin. Oppgjørsdato mer enn fem virkedager etter handledato, og mer enn eller lik 30 dager etter handledato. Løpetid, målt som differanse mellom oppgjørsdato og handledato på mer enn eller lik 30 dager.
FSL	F-1M+1M	Transaksjon med oppgjør på termin. Oppgjørsdato mer enn fem virkedager etter handledato, men mindre enn 30 dager etter handledato. Løpetid, målt som differanse mellom oppgjørsdato og handledato på mer enn eller lik 30 dager.
FSS	F-1M-1M	Transaksjon med oppgjør på termin. Oppgjørsdato mer enn fem virkedager etter handledato, men mindre enn 30 dager etter handledato. Løpetid, målt som differanse mellom oppgjørsdato og handledato på mindre enn 30 dager.

FLS	F+1M-1M	Transaksjon med oppgjør på termin. Oppgjørsdato mer enn fem virkedager etter handledato, og mer enn eller lik 30 dager etter handledato. Løpetid, målt som differanse mellom oppgjørsdato og handledato mindre enn 30 dager.
ON	Over natten	Transaksjon med oppgjørsdato samme dag som handledato og forfall påfølgende virkedag.
_O	Annet	Annet
SN	Spot/Next	Transaksjon med oppgjørsdato to virkedager etter handledato og forfallsdato første virkedag etter oppgjørsdato.
TN	Tomorrow/Next	Transaksjon med oppgjørsdato en virkedag etter handledato og forfallsdato første virkedag etter oppgjørsdato.

FX_CURRENCY

Navn: Valuta. Kolonnen spesifiserer hvilken valuta som byttes mot kroner på nærmeste bein i en valutabytteavtale. For eksempel vil en verdi merket SE i kolonne TRANSACTION_TYPE og USD i kolonne FX_CURRENCY representere transaksjoner der rapportørbanker gir fra seg kroner mot dollar på nærmeste bein i en valutabytteavtale. Tilsvarende for BU (se over). Andre valutaer enn de som er listet opp her kan forekomme i dataene.

Id	Navn	Beskrivelse
_U	Ukjent	Ukjent
_Z	Ikke tilgjengelig	Ikke tilgjengelig
CHF	Sveitsiske franc	Sveitsiske franc
USD	Amerikanske dollar	Amerikanske dollar
EUR	Euro	Euro
DKK	Danske kroner	Danske kroner
ISK	Islandske kroner	Islandske kroner
CAD	Kanadiske dollar	Kanadiske dollar
AUD	Australske dollar	Australian dollar
GBP	Britiske pund	Pound sterling
JPY	Japanese yen	Japanese yen
CNY	Kinesiske yuan	Kinesiske yuan
MXN	Meksikanske peso	Meksikanske peso
CZK	Tjekkiske koruna	Tjekkiske koruna

INR	Indiske rupi	Indiske rupi
KRW	Sør-Koreanske Won	Sør-Koreanske Won
NZD	New Zealandske dollar	New Zealandske dollar
PLN	Polske zloty	Polske zloty
RUB	Russiske rubler	Russiske rubler
SEK	Svenske kroner	Svenske kroner
TRY	Tyrkiske lira	Tyrkiske lira
TWD	Taiwanske dollar	Taiwanske dollar

COLL_ISSUER_AREA

Navn: Type utsteder av sikkerhet. Kolonnen spesifiserer hvilken sektor og ustедertype utstederen av sikkerheten i en sikret transaksjon tilhører. Inndeling er basert på inndeling fra Stamdata.

Id	Navn	Beskrivelse
STA	Stat	Stat
STF	Offentlig institusjon	Offentlig institusjon
STB	Offentlig finansiert bank	Offentlig finansiert bank
FYL	Fylke	Fylke
KOM	Kommune	Kommune
OSF	Selskap kontrollert av en eller flere kommuner	Selskap kontrollert av en eller flere kommuner
FOB	Forretningsbank	Forretningsbank
SPB	Sparebank	Sparebank
KRF	Kredittforetak	Kredittforetak
KRA	Boligkredittforetak	Boligkredittforetak
FOR	Forsikringsselskap	Forsikringsselskap
FIN	Finansielt foretak - ikke bank, boligkredittforetak eller forsikringsselskap	Finansielt foretak - ikke bank, boligkredittforetak eller forsikringsselskap
KFT	Kraftselskap	Kraftselskap
IND	Privat foretak	Privat foretak
UIB	Ukjent utsteder	Ukjent utsteder

_Z	Ikke tilgjengelig	Ikke tilgjengelig
ONU	Overnasjonale utstedere	Overnasjonale utstedere
PRE	Aktiv eierkapital P.E.	Aktiv eierkapital P.E.
HYB	Hypotekbank	Hypotekbank

COLL_SEC_TYPE

Navn: Type sikkerhet. Kolonnen spesifiserer typen sikkerhet i en sikret transaksjon. Inndeling er basert på inndeling fra Stamdata.

Id	Navn	Beskrivelse
0	Lån utstedt av OECD-stater	Lån utstedt av OECD-stater
1	Lån garantert av OECD-stater	Lån garantert av OECD-stater
2	Lån garantert av kommuner og fylkeskommuner	Lån garantert av kommuner og fylkeskommuner
3	Lån utstedt av finansielle institusjoner	Lån utstedt av finansielle institusjoner
4	Obligasjoner med fortrinnsrett	Obligasjoner med fortrinnsrett
5	Lån med pant	Lån med pant
6	Lån med negativ pantsettelse	Lån med negativ pantsettelse
7	Usikrede lån	Usikrede lån
8	Subordinerte lån	Subordinerte lån
9	Lån med garanti	Lån med garanti
10	Lån utstedt av Norsk offentlig foretak	Lån utstedt av Norsk offentlig foretak
11	Selskap risikoklasse 1 (20%)	Selskap risikoklasse 1 (20%)
12	Selskap risikoklasse 2 (50%)	Selskap risikoklasse 2 (50%)
13	Selskap risikoklasse 3, 4 (100%)	Selskap risikoklasse 3, 4 (100%)
14	Selskap risikoklasse 5, 6 (150%)	Selskap risikoklasse 5, 6 (150%)
_U	Ukjent	Ukjent
_Z	Ikke tilgjengelig	Ikke tilgjengelig

COL_ISIN

Navn: ISIN. Gir ISIN-nummer for sikkerhet i en sikret transaksjon.

RATE_TYPE

Navn: Rentetype. Spesifiserer rentetype i en transaksjon. Kun tilgjengelig for usikrede og sikrede transaksjoner (ikke valutabytteavtaler).

Id	Navn	Beskrivelse
VA	Flytende	Flytende
FI	Fast	Fast
_Z	Ikke tilgjengelig	Ikke tilgjengelig

Måleenheter

Beskrivelse av kolonner som måler volum, utestående volum, dato, frekvens og prisinformasjon. Kolonner som inneholder informasjon om renter, terminpunkter og avkorting refererer til transaksjoner på samme dag, ikke utestående volum.

Kolonner	Navn	Beskrivelse
TIME_PERIOD	Tidsperiode	Dato. Spesifiserer dato for omsetning og utstående volum.
V	Volum	Transaksjonsvolum. Transaksjonsvolum referer til omsetning på relevant handledag. Målt i millioner kroner.
VWFP	Volumvektede terminpunkter	Volumvektede terminpunkter for transaksjoner på relevant dag. Kun tilgjengelig for valutabytteavtaler.
O_V	Utestående volum	Utestående volum. Utestående volum beregnes ut fra når transaksjoner har oppgjørs- og forfallsdag. Dette innebærer at om en transaksjon har oppgjørsdag f.eks. to dager etter handledag, vil transaksjonen inkluderes i aggregerte data for transaksjonsvolum (V) to dager før den inkluderes i utestående volum (O_V). Målt i millioner kroner.
VWHC	Volumvektet avkorting	Volumvektet avkorting for transaksjoner på relevant dag. Kun tilgjengelig for sikrede transaksjoner
VWAR	Volumvektet rente	Volumvektet rente for transaksjoner på relevant dag. Kun tilgjengelig for transaksjoner med fastrente
VWAS	Volumvektet påslag i basispunkter	Volumvektet påslag over referanserente, målt i basispunkter. Kun tilgjengelig for transaksjoner priset til et påslag over en referanserente
REF_RATE_INDEX	Referanserente	Referanserente i transaksjon med flytrente.
FREQ	Frekvens	Tidsfrekvens. Tar kun verdien B for virkedag (business). Tall for utestående volum er også inkludert for dager som ikke er virkedager.

3. Eksempler på bruk

Eksempel 1:

Hent ut valutabytteavtaler med løpetid på tre måneder mot amerikanske dollar mellom rapportørbank og utenlandske motparter, hvor rapportørbankene låner kroner (dvs. kjøper NOK på nærmeste bein i valutabytteavtalen).

Filtrer følgende kolonner i datasettet «Valutabytteavtaler»

- MATURITY = «3M»
- FX_CURRENCY = «USD»
- COUNTERPART_TYPE = «FOREIGN»
- TRANSACTION_TYPE = «BU»

Daglig utestående volum vises i kolonnen «O_V» for «Utestående volum». Daglig transaksjonsvolum vises i kolonnen «V» for «Volum». Volumvektede terminpunkter for den dagens transaksjoner vises i kolonnen «VWFP».

Eksempel 2:

Hent ut repo-handler mellom rapportørbank med OMF som sikkerhet:

I datasettet «Sikrede transaksjoner», filtrer følgende kolonner:

- COL_SEC_TYPE = «4»
- COUNTERPART_TYPE = «RPDAGENT»
- TRANSACTION_TYPE = «BO»

Ved å velge kun «TRANSACTION_TYPE» = «BO» for innlån sikrer man at transaksjoner mellom rapportørbank ikke dobbeltelles.

4. Kjente problemstillinger

Under følger en liste over kjente problemstillinger og spørsmål knyttet til dataene. Denne vil bli oppdatert basert på tilbakemeldinger og løpende arbeid med datasettene. Tilbakemeldinger kan gis til moalikviditet@norges-bank.no

- **Omsatt volum (V) og utestående volum (O_V) mellom rapportørbanker rapportert som innlån/buy er ikke alltid det samme som for utlån/sell.** Dette kan skyldes at en av rapportørbankene ikke har oppgitt motpart, har oppgitt marginalt forskjellig volum eller feilrapportering.
- **Utestående volum for innlån i usikrede transaksjoner med en måneds løpetid er kunstig høyt.** Dette skyldes at flere av bankene rapporterer omsetning i rullerende innskudd med litt over 30 dagers løpetid. Fordi disse fornyes daglig, men ikke forfaller før om litt over 30 dager, blir beregningen av utestående volum kunstig høy. For å få et riktigere bilde av omsetningen i denne typen transaksjoner bør man se på daglig omsatt volum (V) i usikrede transaksjoner med løpetid en måned.
- **Volumvektet avkorting i sikrede handler er ikke tilgjengelig.** Dette skyldes utfordringer med datakvalitet. Data vil bli gjort tilgjengelig når kvaliteten er god nok.
- **Utestående volum stiger veldig raskt i begynnelsen av datasettene. Hvorfor?** Beregning av utestående volum er basert på data rapportert av bankene fra og med 2. januar 2020. Utestående volum beregnes som den kummulative summen av nye minus forfallende handler per løpetid, motpartstype etc. Dette fører til at utestående volum stiger kraftig i begynnelsen av datasettene, siden de underliggende dataene ikke inkluderer forfallende handler som ble inngått før 2020.