

# Veiledning til årlig rapportering av pengemarkedsdata

---

Versjon 2.3

05.02.2021

## Veiledning til årlig rapportering av pengemarkedsdata

### 1. Bakgrunn

Norges Bank informerte i brev fra 20. september 2018 at det vil bli innhentet data for transaksjoner i det norske pengemarkedet. Formålet med rapportering av daglige transaksjoner i det norske pengemarkedet er å få bedre innsikt i det norske pengemarkedet. Dataene vil brukes i Norges Banks analyser av implementeringen av pengepolitikken (likviditetsstyringen) og bankenes likviditetsrisiko. Datainnhentingene er dermed nødvendig for å utføre Norges Banks arbeidsoppgaver etter sentralbankloven, og for å støtte bankens tilsyn med finansiell stabilitet, jf. forskriftens § 1.

For banker i kvotegruppe 1 og 2 i NBO gjelder daglig rapportering. For mindre banker (kvotegruppe 3 i NBO) gjelder årlig rapportering. Denne veiledningen gjelder den årlige rapporteringen.

### 2. Rapporteringsomfang og definisjoner

Den årlige rapporteringen av pengemarkedsdata gjelder for norske banker og filialer av utenlandske banker etablert i EØS og Storbritannia i kvotegruppe 3 i oppgjørssystemet.

Rapporteringen skal inkludere alle transaksjoner i pengemarkedsinstrumenter som nevnt under i norske kroner (NOK) og som er bokført i enheter innenfor EØS og Storbritannia.

Konserninterne transaksjoner skal ikke rapporteres. «Konsern» og «konserninterne transaksjoner» er definert i paragraf (15) og (19) i Artikkel 1 i forordning ECB/2014/48.

Rapportørene (juridisk enhet) skal rapportere pengemarkedsdata til Norges Bank for transaksjoner denominert i norske kroner med opprinnelig løpetid opp til og med ett år (definert som transaksjoner med en løpetid på maksimalt 397 dager fra oppgjørsdato) for **tre segmenter**:

- a) **Sikret segment:** gjenkjøpsavtaler inkludert repo/omvendt repo og sell/buy-back og buy/sell-back-avtaler (innlån og utlån)
- b) **Usikret segment:**
  - i) transaksjoner i form av mottatte innskudd, andre usikrede innlån og utstedelse av kortsiktig verdipapirgjeld.
  - ii) transaksjoner i form av plasserte innskudd, andre usikrede utlån og kjøp av kortsiktig verdipapirgjeld (kun kjøp i førstehåndsmarkedet).
- c) **FX-swap:** transaksjoner hvor norske kroner selges/kjøpes mot utenlandsk valuta med avtale om å reversere salget/kjøpet på et avtalt fremtidig tidspunkt.

I den årlige rapporteringen skal det kun rapporteres samlet volum i perioden og samlet antall transaksjoner. Med innlån menes transaksjoner som gir banken tilgang på norske kroner. Med utlån menes transaksjoner der banken gir fra seg norske kroner. Innlån/utlån i feltene for FX-swap betyr kjøp/salg av norske kroner på termin.

Som hovedregel skal det rapporteres transaksjoner mellom rapporteringsenheten og finansielle foretak, offentlig forvaltning, utenlandske sentralbanker og ikke-finansielle foretak.

Relevante motparter og sammenhengen mellom norske sektorkoder fra ORBOF finnes i vedlegg 4 i veiledningen til den daglige rapporteringen.

Transaksjoner med nominelt beløp mindre enn 10 millioner kroner og/eller transaksjoner med foretak definert som «SMB» etter artikkel 153 (4) i Forordning (EU) 575/2013 skal ikke rapporteres. Unntakene gjelder for alle typer relevante transaksjoner og motparter.

Det er kun innskudd med bindingstid, varslingsfrist eller andre begrensninger på uttak som omfattes av rapporteringen. Innskudd uten noen form for binding eller andre begrensninger, transaksjonsinnskudd eller lignende skal ikke rapporteres.

For usikrede utlån skal det kun rapporteres transaksjoner mellom rapportøren og kredittinstitusjoner og utenlandske sentralbanker.

Alle beløp angis i hele kroner og legges inn som tall (ikke formler, linker til andre regneark eller lignende).

Dersom det ikke finnes relevante transaksjoner i ett eller flere segmenter skal det rapporteres blankt.

### **3. Rapporteringsskjema og frister for innlevering**

Veiledningen til rapporteringen vil oppdateres løpende og på Norges Banks nettsider vil den til en hver tids siste oppdaterte versjon være tilgjengelig. Norges Bank vil så langt det er mulig gi rapportørene beskjed om endringer. Rapportørene oppfordres likevel til å følge jevnlig med på innholdet på nettsidene.

Rapporteringsskjemaet er på .xls-format og kan lastes ned fra Norges Banks hjemmeside. Rapportørene må alltid sørge for å benytte siste versjon av skjemaet. Utfylt skjema sendes til [pengemarkedsrapportering@norges-bank.no](mailto:pengemarkedsrapportering@norges-bank.no) senest innen 15 kalenderdager etter utløpet av året.

Spørsmål angående rapporteringen kan rettes til [pengemarkedsrapportering@norges-bank.no](mailto:pengemarkedsrapportering@norges-bank.no)