

Veiledning til daglig rapportering av pengemarkedsdata

Versjon 2.5

2/5/2021

Versjonsnummer	Dato	Beskrivelse
1	06.12.2018	
2	25.01.2019	Endringer i relevante motparter, definisjon av SMB, bruk av LEI-koder og presisering av valgfrie felter
2.1	18.02.2019	Innføring av nedre volumgrense på transaksjoner og endret frist for innlevering i en periode
2.2	08.03.2019	Mapping av ORBOF-koder og S-koder. Endring av rentekonvensjon.
2.3	11.09.2019	ISIN-kompatibel kode for foliorente og presiseringer knyttet til SMB
2.4	15.11.2019	Presiseringer knyttet til tidsfrister
2.5	05.02.2021	EØS + Storbritannia i avsnitt 2.1

Innhold

Daglig rapportering av pengemarkedsdata (RPD) i norske kroner	3
1 Bakgrunn	3
2 Generelle krav	3
2.1 Rapporteringsomfang	3
2.2 Pengemarkedssegmenter	3
2.2.1 Relevante motparter og definisjoner	4
2.3 Rapporteringsfrister, endringer og feilrapportering	4
2.3.1 Rapporteringsfrister	4
2.3.2 Endringer og korrigeringer i tidligere rapporterte transaksjoner	5
2.3.3 Tidsfrister for endringer og korrigeringer	5
2.3.4 Rapportering uten volumer	6
3 Rapporteringsstruktur	6
3.1 Business Application header	8
3.2 Rapporteringsoverskrift (Reporting header)	9
3.3 Rapporteringsmelding (Reporting message)	10
3.3.1 Sikret segment	10
3.3.2 Usikret segment	16
3.3.3 FX-swap	22
Vedlegg 1: Kodeliste	26
Vedlegg 2: Kodeliste for underliggende rente uten ISIN	27
Vedlegg 3: Eksempler på rapportering	27
Vedlegg 4: Mapping av ORBOF-koder og S-koder	31
Vedlegg 5: Kontaktskjema overnattentransaksjoner	32

Daglig rapportering av pengemarkedsdata (RPD) i norske kroner

1 Bakgrunn

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. Datainnhenting er dermed nødvendig for å utføre Norges Banks arbeidsoppgaver etter sentralbankloven, og for å støtte Norges Banks tilsyn med finansiell stabilitet, jf. forskriftens § 1.

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.

2 Generelle krav

2.1 Rapporteringsomfang

Den daglige rapporteringen omfatter norske banker og filialer av utenlandske banker etablert i EØS og Storbritannia i kvotegruppe 1 og 2 i Norges Banks oppgjørssystem (NBO). Kvotegruppe 3-banker skal kun rapportere årlig. Det skal kun rapporteres på solo-nivå (juridisk enhet). Norges Bank kan kreve rapportering av andre enn de nevnt over.

Rapporteringen skal inkludere alle transaksjoner i pengemarkedsinstrumenter som nevnt i avsnitt 2.2 denominert i norske kroner (NOK) og som er bokført i enheter innenfor EØS-området 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.

2.2 Pengemarkedssegmenter

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 oppgjørsmøtet) 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.

2.2.1 Relevante motparter og definisjoner

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

Det skal rapporteres for både norske og utenlandske motparter. Så langt det er mulig skal LEI-kode benyttes for å identifisere motparten. Dersom motparten ikke har LEI-kode skal sektor og land rapporteres. I tilfeller der utenlandske motparter ikke har LEI-kode skal sektorkoden angis som den sektoren motparten hadde tilhørt dersom den var norsk. For eksempel skal en motpart som er utenlandsk bank rapporteres med kode S122 (Banker og kredittforetak) og landkode. Relevante motparter og sammenhengen mellom norske sektorkoder fra ORBOF og S-koder i rapporteringen finnes i vedlegg 4.

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

I artikkel 153 (4) er «SMB» definert som foretak med årlig omsetning under 50 mEUR på øverste konsoliderte nivå. Det vil si at dersom motparten er del av en konsolidert gruppe er det konsernets samlede årlige omsetning som er relevant. Siste avsnitt i artikkelen sier også at dersom årlig omsetning ikke er en relevant indikator, så skal totale eiendeler benyttes i stedet.

For rapporteringen gjelder følgende presiseringer for SMB:

- For motparter i sektorene S123-S129 er ikke årlig omsetning på gruppenivå en relevant indikator for foretakenes størrelse. I stedet skal totale eiendeler på øverste konsoliderte nivå benyttes som indikator.
- For motparter som er banker (S122), sentralbanker (S121) og offentlig forvaltning (S13) gjelder ikke unntaket som SMB. Her er det kun grensen på transaksjonsvolum som gjelder.

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

2.3 Rapporteringsfrister, endringer og feilrapportering

2.3.1 Rapporteringsfrister

Den daglige rapporteringen gjelder for alle bankdager. Rapporteringen skal leveres til Norges Bank mellom kl. 18.00 samme dag og kl. 07.00 neste bankdag. For eksempel skal en transaksjon gjennomført på mandag rapporteres mellom kl. 18.00 på mandag og kl. 07.00 på tirsdag. Dersom tirsdag er en helligdag, vil fristen for rapportering være onsdag kl. 07.00.

Fristen for rapportering vil midlertidig endres fra kl. 07.00 neste bankdag til kl. 11.00 neste bankdag. Seks måneder etter at rapporteringen har offisiell start vil fristen settes tilbake til kl. 07.00 neste bankdag.

Tidsfristene gjelder fullstendig og korrekt rapportering i henhold til denne rapporteringsveiledningen. Det bør derfor legges inn en margin for å rette opp eventuelle valideringsfeil i rapporterte transaksjoner. Hvis rapportøren vet at den vil få problemer med å rapportere innen tidsfristen skal Norges Bank underrettes så fort det lar seg gjøre. Det skal også informeres om når det forventes at rapporteringen vil være levert.

2.3.2 Endringer og korrigeringer i tidligere rapporterte transaksjoner

Dersom det oppdages feil ved tidligere innsendte data skal dette korrigeres slik at de rapporterte transaksjonene alltid reflekterer de vilkår og betingelser som faktisk gjelder. Ved endringer av tidligere rapporterte transaksjoner skal det opprinnelige transaksjonsnummeret benyttes. Slike endringer kan normalt sendes inn som del av den daglige rapporteringen, og trenger ikke å sendes inn som en separat fil. Endringer klassifiseres som:

- Tillegg (AMND): Feil/endringer i tidligere rapporterte transaksjoner som rettes og sendes inn på nytt på rapportørens eget initiativ.
- Korreksjon (CORR): Feil som rapportøren retter etter forespørsel fra Norges Bank
- Kansellering (CANC): Transaksjonsdata som ikke skulle ha vært rapportert eller av andre grunner skal slettes.

Endringer i for eksempel rente eller løpetid som følge reforhandlinger av vilkår og betingelser i tidligere rapporterte transaksjoner rapporteres på nytt som ny transaksjon (NEWT).

Novasjon (bytte av motpart) rapporteres i utgangspunktet på samme måte som reforhandlede transaksjoner. Meldingen flagges i tillegg som novasjon (NOVA) og transaksjonsnummeret til den opprinnelige transaksjonen rapporteres i feltet «RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION»

2.3.3 Tidsfrister for endringer og korrigeringer¹

Generelt skal feil som oppdages av rapportør rettes innen rimelig tid. Unntaket er usikrede transaksjoner med løpetid overnatten. Hvis rapportør oppdager feil i overnattentransaksjoner etter kl. 07.00 på rapporteringsdag, må dette rettes så fort som mulig og Norges Bank skal informeres. Usikrede overnattentransaksjoner er transaksjoner med oppgjør dag t og forfall dag t+1 som har rapporteringsfrist dag t+1 innen det usikrede segmentet.

Innrapportere transaksjoner vil gjennomgå sjekker utover automatisk validering av de innrapporterte skjemaene. I denne forbindelse kan det oppstå spørsmål fra Norges Bank knyttet til transaksjonene. Krav til hvor fort Norges Bank skal ha svar, er avhengig av segment, se tabell.

Segment	Tidsfrist
Usikrede transaksjoner med løpetid overnatten	Rapportør begynner undersøkelser umiddelbart etter at forespørsel er mottatt, og innen 10 minutter anerkjenner at forespørselen er mottatt. Innen 30 minutter skal det foreligge et svar og evt. feilretting
Usikret segment med andre løpetider enn over natten, sikret segment, FX-swapper	Anerkjenne forespørsel innen utgangen av dagen og svar/retting innen rimelig tid.

Usikrede transaksjoner med løpetid over natten gjennomgås mellom 07.30 og 09.00, mens øvrige transaksjoner vil bli gjennomgått på et senere tidspunkt. For usikrede overnattentransaksjoner kreves det derfor at det er personer hos rapportøren som kan svare på forespørsler fra Norges Bank fra kl. 07.30.

¹ Alle tidsfrister i dette kapittelet er forskjøvet med 4 timer til 6 måneder etter rapporteringens offisielle start

For usikrede overnattentransaksjoner kreves det at det er et eget kontaktpunkt som er oppgitt i skjemaet i vedlegg 5. Dette fylles ut og sendes til pengemarkedsrapportering@norges-bank.no. Ved endringer sendes nytt skjema inn til samme adresse. Utfallet av en forespørsel fra Norges Bank kan for eksempel være en bekreftelse på at transaksjonen er riktig rapportert, informasjon om transaksjonen, at det blir iverksatt undersøkelser og at en transaksjon blir endret (AMND/CORR/CANC). Kontaktpunktet må derfor på en sikker måte kunne håndtere slike forespørsler. Forespørsler om rapportering i andre segmenter vil bli sendt til kontaktpunktene oppgitt i onboarding-skjemaet (BusinessUserEmail).

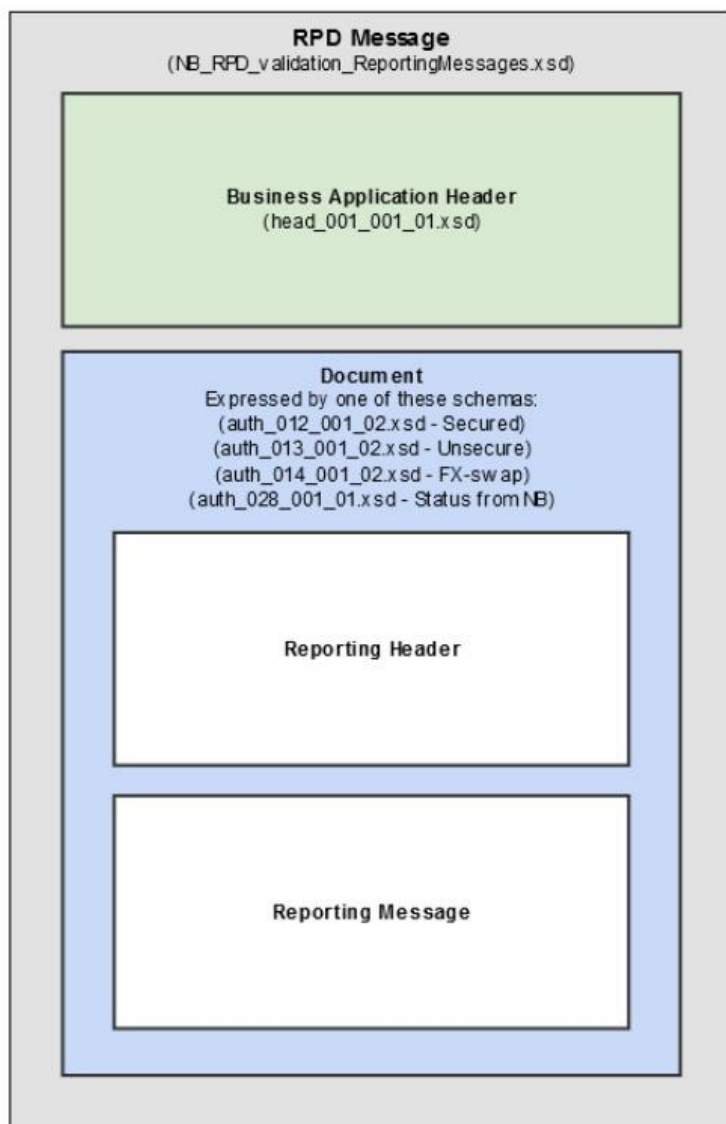
2.3.4 Rapportering uten volumer

Selv om det ikke er gjennomført relevante transaksjoner i et av segmentene skal det likevel rapporteres. Det skal ikke rapporteres noen verdier, men rapporteringsmeldingen må flagges med «NOTX».

3 Rapporteringsstruktur

Filformatet som benyttes består av to komponenter

- a) Applikasjonsheader (Business Application Header)
- b) Et dokument som består av to deler
 - i. Rapporteringsheader (Reporting Header): Angir rapporteringsenhet, referanseperiode etc.
 - ii. Rapporteringsmelding (Reporting Message): Inneholder informasjon om hver enkelt transaksjon



Tegningen viser sammensetningen av skjemaene som knytter sammen de ulike blokkene i meldingen.

- NB_RPD_validation_ReportingMessages.xsd
 - Dette skjemaet er en teknisk wrapper med referanse til skjema for Business Application Header (BAH) og skjema for innkommende innrapporteringsområde (Secure, Unsecure eller FX-swap) eller utgående status som svar på mottatt data.
- head_001_001_01.xsd
 - Dette skjemaet beskriver strukturen på BAH. Alle meldinger skal ha en BAH.
- auth_012_001_02.xsd
 - Meldingsformat for [Money Market Secured Market Statistical Report V02 \(auth.012.001.02\)](#)
 - Skjemaet beskriver formatet for transaksjoner i det sikrede segmentet.
- auth_013_001_02.xsd
 - Meldingsformat for [Money Market Unsecured Market Statistical Report V02 \(auth.013.001.02\)](#)
 - Skjemaet beskriver formatet for transaksjoner i det usikrede segmentet.
- auth_014_001_02.xsd

- Meldingsformat for [Money Market Foreign Exchange Swaps Statistical Report V02 \(auth.014.001.02\)](#)
- Skjemaet beskriver formatet for FX-swap-transaksjoner
- auth_028_001_01.xsd
 - Meldingsformat for [Money Market Statistical Report Status Advice V01 \(auth.028.001.01\)](#)
 - Brukes av Norges Bank for å formidle status på mottatte transaksjoner tilbake til innsender.

3.1 Business Application header

Tabellen under beskriver variablene i Business Application Header.

Variabelnavn	Beskrivelse
Business Message Identifier	Bokstavstreng som unikt skal identifisere meldingen sendt fra en innsender. Systemet vil avvise duplikate ID'er fra samme innsender (LEI).
Sender	Identifiserer avsender av meldingen i form av rapportørens LEI-kode (Legal Entity Identifier). Variabelen heter 'Fr' i applikasjonsheaderen i RPD-meldingen
Receiver	Identifiserer mottaker av meldingen i form av Norges Banks LEI-kode. Variabelen heter 'To' i applikasjonsheaderen i RPD-meldingen
Business Service	Angir hvilken tjeneste rapporten sendes til. Variabelen har to gyldige verdier: NB_RPD_PROD og NB_RPD_TEST. NB_RPD_PROD skal benyttes for all vanlig rapportering. NB_RPD_TEST skal kun benyttes for testdata.
Market Segment Identifier	Angir hvilket markedssegment det rapporteres for; sikret, usikret eller FX-swap. Variabelen heter 'MsgDefldr' i applikasjonsheaderen i RPD-meldingen
Creation Date	Dato for når filen er generert

Variabelkode	Variabelnavn	Type	Eksempel
H10	Business Message Identifier	Streng	INTREF012345
H20	Sender	Streng LEI [ISO17442]	
H30	Receiver	Streng LEI [ISO17442]	"54930006E2WAK3IAXE34" refererer til Norges Bank
H40	Business Service	Streng. Lengde: 11 NB_PMD_PROD og NB_PMD_TEST	NB_RPD_PROD Eller NB_RPD_TEST
H50	Market Segment Identifier	Streng. Lengde: 15 CL_MARKET_SEGMENT (se vedlegg 1)	auth.012.001.02 referer til det sikrede segmentet

H60	Creation Date	Dato/tid etter ISO-standard 20022 og ISO-standard 8601. YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	2016-07-01T19:30:00Z
-----	---------------	---	----------------------

3.2 Rapporteringsoverskrift (Reporting header)

Variabelnavn	Beskrivelse
Reporting Agent	LEI-kode for rapporteringsagent
Reference Period	Start og slutt (dato/tid) for perioden det rapporteres for.

Variabelkode	Variabelnavn	Type	Eksempel
H70	Reporting Agent	Streng. Max lengde: 20 [ISO17442]	
H80	Reference Period	Dato/tid [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm Informasjon om tidssone ('+/-hh:mm') må inkluderes.	2016-07-01T18:00:00+01:00 2016-07-02T18:00:00+01:00

3.3 Rapporteringsmelding (Reporting message)

Tabellen under er gjeldende for alle tre segmenter.

Variabelnavn	Beskrivelse
Data Set Action	Angir innholdet i meldingen. Dersom rapportøren ikke har gjennomført relevante transaksjoner i den gjeldende tidsperioden i det gjeldende segmentet, rapporteres «NOTX» For meldinger med transaksjoner kan variabelen utelates.

Variabelkode	Variabelnavn	Type	Eksempel
D10	Data Set Action	Streng CL_DATA_SET_ACTION (se vedlegg 1)	NOTX

3.3.1 Sikret segment

Det sikrede segmentet omfatter gjenkjøpsavtaler inkludert repo/omvendt repo og sell/buy-back og buy/sell-back-avtaler (innlån og utlån).

Nærmere om tri-party repo og buy/sell-backs:

- Dersom sikkerhetene i transaksjonen kan identifiseres med ISIN-nummer skal ISIN rapporteres. I dette tilfellet trenger ikke type sikkerheter eller sikkerheter angitt av den sentrale motparten å rapporteres.
- Dersom sikkerhetene ikke kan identifiseres med ISIN-nummer må type sikkerhet rapporteres. I dette tilfellet skal koden for klassifisering av finansielle instrumenter (CFI) benyttes.
- Dersom sikkerhetene består av flere eiendelsklasser benyttes CFI-koden for den eiendelsklassen som utgjør størst andel av sikkerhetene.

Gjenkjøpsavtaler uten definert løpetid:

- Transaksjoner uten definert løpetid rapporteres på daglig basis fra oppgjørsdato, med løpetid over natten eller første dato for mulig forfall (for eksempel varslingsfrist som gjør at første mulige forfall ikke kan være neste dag)

Eksempel 1)

Gjenkjøpsavtale uten definert løpetid med handledato T og oppgjør T+2. På tidspunkt T+4 avtaler partene og la avtalen forfalle på tidspunkt T+6.

Dag	Handledato	Opgjøringsdato	Forfallsdato	Transaksjonsnr. (PTI)	Kommentar
T	T	T+2	T+3	«1»	Rapportering av ny transaksjon
T+1					Ingen rapportering
T+2					Ingen rapportering
T+3	T+3	T+3	T+4	«2»	Rullering (ny transaksjon)
T+4	T+4	T+4	T+5	«3»	Rullering (ny transaksjon)
T+5	T+5	T+5	T+6	«4»	Rullering (ny transaksjon)
T+6					Forfall. Ingen rapportering

Eksempel 2)

Gjenkjøpsavtale uten definert løpetid med handledato T og oppgjørsdato T. På tidspunkt T+4 avtaler partene og la avtalen forfalle samme dag og erstatte den med en ny avtale med oppgjør T+4 og forfall T+6.

Dag	Handledato	Oppgjørsdato	Forfallsdato	Transaksjonsnr. (PTI)	Kommentar
T	T	T	T+1	«1»	Rapportering av ny transaksjon
T+1	T+1	T+1	T+2	«2»	Rullering (ny transaksjon)
T+2	T+2	T+2	T+3	«3»	Rullering (ny transaksjon)
T+3	T+3	T+3	T+4	«4»	Rullering (ny transaksjon)
T+4	T+4	T+4	T+6	«5»	Ny transaksjon med fast løpetid
T+5					Ingen rapportering
T+6					Ingen rapportering

3.3.1.1 Variabeldefinisjoner – sikret

Tabellen under spesifiserer hver enkelt variabel som skal rapporteres for hver transaksjon. Noen variabler er valgfrie å rapportere (lyseblå felt). Det oppfordres til å rapportere alle variabler så langt det er mulig.

Navn på variabel	Beskrivelse
REPORTED TRANSACTION STATUS	Status for transaksjonen. Informasjon om transaksjonen er: <ul style="list-style-type: none"> - Ny - et tillegg til en tidligere rapportert transaksjon - en kansellering av en tidligere rapportert transaksjon - en korrigering av en tidligere rapportert transaksjon
NOVATION STATUS	Om transaksjonen er en novasjon (endring av transaksjonsmotpart) <i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Unik kode som identifiserer transaksjonen. <i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Bankens egen interne transaksjonskode. PTI-en må være unik per markedssegment og rapporteringsenhet
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Hvis transaksjonen er en novasjon rapporteres den opprinnelige transaksjonskoden (PTI). <i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt</i>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	PTI som motparten angir i den samme transaksjonen. <i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Legal Entity Identifier (LEI) for motparten. For motparter som ikke har LEI skal «Counterparty Sector» og «Counterparty location» brukes i stedet.
COUNTERPARTY SECTOR	Angir den institusjonelle sektoren til motparten, for eksempel ikke-finansielle foretak, sentralbank osv. COUNTERPARTY SECTOR må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY IDENTIFICATION ikke rapporteres.

	Variabelen heter 'Sctr' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i meldingen.
COUNTERPARTY LOCATION	Angir landkoden (ISO) til landet der motparten er hjemmehørende. COUNTERPARTY LOCATION må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY LOCATION ikke rapporteres. Variabelen heter 'Lctn' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i meldingen.
TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION	LEI-kode for tri-party-motpart <i> Dette feltet er påkrevd for alle tri-party-transaksjoner.</i>
TRADE DATE	Dato og klokkeslett for når partene har inngått avtale om transaksjonen. Dersom klokkeslett ikke finnes rapporteres kun dato.
SETTLEMENT DATE	Dato for oppgjør. Dersom transaksjonen er rullering av tidligere rapporterte transaksjoner angis dato for rullering. Tekniske feil, eller andre forhold, som gjør at faktisk oppgjørsdato avviker fra avtalt oppgjørsdato, gir ikke opphav til endring av rapportering.
MATURITY DATE	Dato for forfall. Dersom transaksjonen ikke har avtalt forfallsdato, skal forfallsdato i utgangspunktet være første dato for mulig forfall.
TRANSACTION TYPE	Angir om transaksjonen er innlån eller utlån.
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Nominelt beløp i NOK som lånes inn eller ut. Det må angis at beløpet er i NOK.
RATE TYPE	Angir om renten i avtalen er fast eller flytende
DEAL RATE	Angir renten i gjenkjøpsavtalen etter ACT/365 rentekonvensjon. Dersom verdipapirlån kompenseres med avgift i stedet for rente, skal avgiften omregnes til en rente basert på forholdet mellom avgiften og det nominelle lånebeløpet multiplisert med 365 og dividert på antall dager mellom oppgjørsdato og forfallsdato for transaksjonen. Kun faktiske renter skal rapporteres. Verdien kan være positiv eller negativ. Den skal representere den kontraktuelle, avtale renten som kompenserer den som låner ut det nominelle beløpet. <i>Variabelen skal kun rapporteres dersom RATE TYPE er fastrente.</i>
REFERENCE RATE INDEX	Angir ISIN-koden for den underliggende referanserenten som ligger til grunn for gjenkjøpsavtaler med flytende rente. Dersom referanserenten ikke har ISIN-nummer benyttes den ISIN-kompatible koden angitt i vedlegg 2. Variabelen finnes i 'FloatingRateRepurchaseAgreement'-blokken i RPD-meldingen.
BASIS POINT SPREAD	Angir antall basispunkter som legges til eller trekkes fra den underliggende referanserenten. <i>Rapporteres kun for avtaler med flytende rente</i>
COLLATERAL ISIN	Angir ISIN-koden for eiendelen som stilles som sikkerhet.

	<p>COLLATERAL ISIN kan klassifiseres i henhold til tre kategorier i 'Valuation'-blokken av 'Collateral'-blokken av RPD-meldingen:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Enkelt sikkerhet/pant hvis verdipapiret som brukes som sikkerhet kan identifiseres med ett enkelt ISIN-nummer - Flere sikkerheter hvis verdipapirene som brukes som sikkerhet kan identifiseres med individuelle ISIN. Feltet er repeterende slik at flere ISIN kan rapporteres - Sikkerhetsmasse hvis sikkerhetene er i form av flåtepant/gruppepant i en beholdning med verdipapirer. Dersom gruppepant kan identifiseres med en generisk ISIN skal denne rapporteres. Hvis ikke skal det rapporteres i COLLATERAL TYPE-feltet i 'OtherCollateral'-blokken RPD-meldingen. <p>Dette feltet er valgfritt for: <i>(1) Tri-party-gjenkjøpsavtaler med flåtepant uten generisk ISIN.</i> <i>(2) Sikkerheter der det ikke eksisterer ISIN.</i></p> <p>Dersom COLLATERAL ISIN ikke oppgis skal det rapporteres COLLATERAL TYPE, COLLATERAL ISSUER SECTOR og COLLATERAL POOL.</p> <p>Variabelen heter 'ISIN' in RPD-meldingen.</p>
COLLATERAL POOL	<p>Angir om sikkerhetene som stilles er i form av en gruppe sikkerheter (flåtepant/gruppepant).</p> <p>Variabelen heter 'PoolSts' og finnes i 'OtherCollateral'-blokken i RPD-meldingen.</p>
COLLATERAL TYPE	<p>Angir eiendelsklassen til sikkerheter som stilles. Hvis sikkerhetene består av flere eiendelsklasser rapporteres den eiendelsklassen som utgjør mest av gruppepantet.</p> <p><i>Dette feltet er obligatorisk dersom sikkerhetene ikke kan identifiseres med ISIN. Dersom individuelle ISIN er rapportert skal det ikke rapporteres noe her.</i></p> <p>Variabelen heter 'Tp' og finnes i 'OtherCollateral'-blokken i RPD-meldingen.</p>
COLLATERAL ISSUER SECTOR	<p>Angir den institusjonelle sektoren til utsteder av verdipapirene som stilles som sikkerhet.</p> <p><i>Dersom individuelle ISIN er rapportert skal det ikke rapporteres noe her.</i></p> <p>Variabelen heter 'Sctr' og finnes i 'OtherCollateral'-blokken i RPD-meldingen.</p>
SPECIAL COLLATERAL INDICATOR	<p>Angir alle gjenkjøpsavtaler med "general collateral" (GC repo) og spesielle sikkerheter.</p> <ul style="list-style-type: none"> - GC repo er gjenkjøpsavtaler der utlåner av verdipapir selv bestemmer hvilke papirer som lånes ut basert på forhåndsdefinerte kriterier - Spesielle sikkerheter er avtaler der utlåner av cash forespør et bestemt verdipapir (ISIN) som sikkerhet. <p><i>Dette feltet er valgfritt, men bør rapporteres dersom det er mulig.</i></p> <p>Variabelen finnes i 'Collateral'-blokken i RPD-meldingen</p>

COLLATERAL NOMINAL AMOUNT	<p>Angir det nominelle beløpet i norske kroner, som stilles som sikkerhet. For en obligasjon er dette det nominelle beløpet av obligasjonen som stilles som sikkerhet.</p> <p><i>Dette feltet er valgfritt for Tri-party-gjenkjøpsavtaler med gruppepant uten generisk ISIN og pant der det ikke eksisterer ISIN.</i></p> <p>I dette feltet skal det rapporteres nominell verdi for hvert verdipapir som er pantsatt. Det kan rapporteres flere verdier dersom det er flere verdipapirer som er pantsatt.</p> <p>Variabelen heter 'NominalAmount' i RPD-meldingen. Meldingen må angi at det rapporteres i NOK.</p>
COLLATERAL HAIRCUT	<p>Angir avkortning på sikkerhetene. Avkortningen beregnes på følgende måte:</p> <p>100 - (ut- eller innlånsvolum/markedsverdi inkludert påløpte renter på sikkerhetene)*100.</p> <p>Dette feltet er kun obligatorisk for gjenkjøpsavtaler med et enkelt verdipapir som pant, og valgfritt for tri-party-gjenkjøpsavtaler og alle handler med gruppepant/flåtepant.</p> <p>Variabelen finnes i 'Collateral'-blokken og heter 'Hrcut' i RPD-meldingen.</p>

3.3.1.2 Variabelkoder – sikret

Variabelkode	Variabelnavn	Type	Eksempel
S10	REPORTED TRANSACTION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_ STATUS (se vedlegg 1)	NEWT
S15	NOVATION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_NOVATION_STATUS (se vedlegg 1)	NONO
S20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Streng. Maks Lengde: 105 Unik transaksjons (UTI) Opp til 105 alfanumeriske tegn. 4 spesialtegn tillates ':', ',', '-', '_' Spesialtegn kan ikke brukes i start og slutt. Mellomrom kan ikke brukes.	
S30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105. Unikt transaksjonsnummer per rapportør og markedssegment.	c0d4683e-cdbc-4311- 97a3-84792a228bdb
S35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	

	ON		
S40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	
S50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Streng. Lengde: 20 Legal Entity Identifier (LEI) er en 20-sifret alfanumerisk kode som er unik for selskaper med virksomhet i finansielle markeder. (ISO17442)	«549300GKFG0RYRRQ1414» refererer til DNB Bank ASA
S60	COUNTERPARTY SECTOR	Streng. Maks lengde: 4 Refererer til institusjonell sektor etter ESA 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se vedlegg 1)	«S11» refererer til "Ikke-finansielle foretak
S70	COUNTERPARTY LOCATION	Streng. Lengde: 2 [ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se vedlegg 1)	«NO» refererer til Norge
S80	TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION	Samme format som 'COUNTERPARTY LOCATION'	
S90	TRADE DATE	Dato/tid [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>eller</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Informasjon om tidssone (+/-hh:mm) skal inkluderes. Lokal tid uten «+/-hh:mm» er ikke tillat <i>Eller</i> Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26T09:00:00+00:00 refererer til 26. november 2014 kl. 9:00 (GMT) <i>Eller</i> 2014-11-26 refererer til 26. november 2014.
S100	SETTLEMENT DATE	Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
S110	MATURITY DATE	Date [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
S120	TRANSACTION TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (se vedlegg 1)	'BORR' står for innlån 'LEND' står for utlån

S130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt tall. Desimaler: opp til 5 Valutakode [ISO 4127]	1 000 000 000 NOK, hvor 'NOK' står for norske kroner. Rapportert valuta skal alltid være norske kroner.
S140	RATE TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_RATE_TYPE (se vedlegg 1)	"VARI" står for flytende rente
S150	DEAL RATE	Numerisk. Maks total lengde: 11 Positive eller negative tall. Desimaler: opp til 10 Enhet: Prosent	10.234 for en rente på 10.234 prosent.
S160	REFERENCE RATE INDEX	Streng. Lengde: 12 ISIN-nummer [ISO6166] eller ISIN-kompatibel kode fra vedlegg 2	'NIBOR3M00009' står for Nibor 3 mnd.
S170	BASIS POINT SPREAD	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt eller negativt tall. Desimaler: 0 Enhet: Basispunkt	1023 for en spread på 10.234%. Ettersom enheten er basispunkter rundes 10.234 % ned til 10.23 % og deretter konvertert til 1023.
S180	COLLATERAL ISIN	Streng. Lengde: 12 Flere ISIN kan rapporteres dersom det er flere sikkerheter. [ISO6166]	'NO0010646813' står for norsk statsobligasjon (NST475)
S190	COLLATERAL POOL	Streng. Lengde: 4 CL_COLLATERAL_POOL (see vedlegg 1)	'POOL' står for gruppesikkerheter
S200	COLLATERAL TYPE	Streng. Lengde: 6 Koden for klassifisering av finansielle instrumenter (CFI) skal benyttes. [ISO 10962]	'ESXXXX' står for aksjer
S210	COLLATERAL ISSUER SECTOR	Streng. Maks lengde: 4 Refererer til institusjonell sektor etter ESA 2010. CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR (se vedlegg 1)	"S13" refererer til offentlig forvaltning
S220	SPECIAL COLLATERAL INDICATOR	Streng. Lengde: 4 CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR (se vedlegg 1) Valgfri.	'GENE' står for generelle sikkerheter (GC). 'SPEC' står for spesielle sikkerheter.
S230	COLLATERAL NOMINAL AMOUNT	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt tall. Flere beløp kan rapporteres dersom det er flere sikkerheter. Desimaler: opp til 5 Valuta [ISO 4127]	1 000 000 000 NOK, hvor 'NOK' står for norske kroner. Rapportert valuta skal alltid være norske kroner
S240	COLLATERAL HAIRCUT	Numerisk. Maks total lengde: 11 Positivt eller negativt tall. Desimaler: opp til 10 Enhet: Prosent	1.234 for en avkortning på 1,234 prosent

3.3.2 Usikret segment

Det usikrede segmentet omfatter:

- 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).

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

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.

Som hovedregel skal innskudd rapporteres hver dag med løpetid over natten. For innskudd med varslingsfrist for uttak eller bindingstid skal dette reflekteres i løpetiden. Rullering av innskudd skal rapporteres som en ny transaksjon med nytt transaksjonsnummer.

Eksempel: Innskudd med 31 dagers varslingsfrist

Tabellen under viser hvordan et innskudd med 31 dagers varslingsfrist mottatt på tidspunkt T skal rapporteres. På tidspunkt T+10 varsler kunden om uttak og på tidspunkt T+41 tar kunden ut hele innskuddet.

Dag	Transaksjon	Beløp	Transaksjonsnr. (PTI)	Løpetid
T	Nytt innskudd	100 mill.	«1»	31 dager
T+1	Rullering	100 mill.	«2»	31 dager
...
T+10	Rullering og varslingsfrist om uttak	100 mill.	«11»	31 dager
T+11	Rullering	100 mill.	«12»	30 dager
...
T+40		100 mill.	«41»	O/N
T+40	Uttak	0 (ingen rapportering)	-	

3.3.2.1 Variabeldefinisjoner – usikret

Tabellen under spesifiserer hver enkelt variabel som skal rapporteres for hver transaksjon. Noen variabler er valgfrie å rapportere (lyseblå felt). Det oppfordres til å rapportere alle variabler så langt det er mulig.

Variabelnavn	Beskrivelse
REPORTED TRANSACTION STATUS	Status for transaksjonen. Informasjon om transaksjonen er: <ul style="list-style-type: none"> - Ny - et tillegg til en tidligere rapportert transaksjon - en kansellering av en tidligere rapportert transaksjon - en korrigering av en tidligere rapportert transaksjon
NOVATION STATUS	Om transaksjonen er en novasjon (endring av transaksjonsmotpart) <i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Unik kode som identifiserer transaksjonen. <i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Bankens egen interne transaksjonskode. PTI-en må være unik per markedssegment og rapporteringsenhet.

RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	<p>Hvis transaksjonen er en novasjon rapporteres den opprinnelige transaksjonskoden (PTI).</p> <p><i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt</i></p>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	<p>PTI som motparten angir i den samme transaksjonen.</p> <p><i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i></p>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION	<p>Legal Entity Identifier (LEI) for motparten.</p> <p>For motparter som ikke har LEI skal «Counterparty Sector» og «Counterparty location» brukes i stedet.</p> <p>Denne variabelen heter 'LEI' i RPD-meldingen og finnes i 'CounterpartyIdentification'-blokken i meldingen.</p>
COUNTERPARTY SECTOR	<p>Angir den institusjonelle sektoren til motparten, for eksempel ikke-finansielle foretak, sentralbank osv.</p> <p>COUNTERPARTY SECTOR må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY IDENTIFICATION ikke rapporteres.</p> <p>Variabelen heter 'Sctr' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i meldingen</p> <p>Variabelen angis som 'Sector' i RPD-meldingen og står under 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification' -blokken i meldingen.</p>
COUNTERPARTY LOCATION	<p>Angir landkoden (ISO) til landet der motparten er hjemmehørende.</p> <p>COUNTERPARTY LOCATION må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY IDENTIFICATION ikke rapporteres.</p> <p>Variabelen heter 'Lctn' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i meldingen.</p>
TRADE DATE	<p>Dato og klokkeslett for når partene har inngått avtale om transaksjonen. Dersom klokkeslett ikke finnes rapporteres kun dato.</p> <p>TRADE DATE må alltid være før eller på samme tid som SETTLEMENT DATE. For novasjoner kan imidlertid TRADE DATE være etter SETTLEMENT DATE.</p>
SETTLEMENT DATE	<p>Dato for oppgjør. Dersom transaksjonen er rulling av tidligere rapporterte transaksjoner angis dato for rulling. Tekniske feil, eller andre forhold, som gjør at faktisk oppgjørsdato avviker fra avtalt oppgjørsdato, gir ikke opphav til endring av rapportering.</p>
MATURITY DATE	<p>Datoen hvor låntager skal tilbakebetale beløpet til långiver eller hvor gjeldsinstrumentet forfaller og skal tilbakebetales.</p> <p>For instrumenter med kjøps- og salgsoptaksjoner skal den endelige forfallsdatoen oppgis.</p> <p>Som hovedregel skal innskudd rapporteres hver dag med løpetid over natten. For innskudd med varslingsfrist for uttak eller bindingstid skal dette reflekteres i løpetiden.</p>

INSTRUMENT TYPE	Variabelen angir hvilket instrument som benyttes til innlån/utlån.
TRANSACTION TYPE	Angir om transaksjonen er innlån eller utlån.
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Nominelt beløp i NOK som lånes inn eller ut. Det må angis at beløpet er i NOK.
TRANSACTION DEAL PRICE	<p>Verdipapirets pris (inkl. påløpte kupongrenter) ved utstedelse eller kjøp i prosent.</p> <p>For usikrede innskudd skal transaksjonsprisen rapporteres som 100.</p> <p>Variabelen heter 'DealPric' i RPD-meldingen.</p>
RATE TYPE	<p>Mulige verdier:</p> <ul style="list-style-type: none"> • fastrente for innskudd og gjeldsinstrumenter med fastrente. • flytende rente for gjeldsinstrumenter og usikrede innskudd hvor utbetaling ved forfall eller for en periode avhenger av verdien på underliggende referanserente.
DEAL RATE	<p>Renten som betales eller mottas på innskudd uttrykt etter ACT/365 rentekonvensjon. For gjeldsinstrumenter rapporteres den renten instrumentet ble utstedt til eller kjøpt uttrykt etter ACT/365 rentekonvensjon.</p> <p><i>Skal bare rapporteres dersom RATE TYPE er fastrente.</i></p>
REFERENCE RATE INDEX	<p>Angir ISIN-nummeret til den underliggende referanserenten som benyttes for å beregne de periodevise rentebetalinger.</p> <p>Dersom referanserenten ikke har ISIN-nummer benyttes den ISIN-kompatible koden angitt i vedlegg 2.</p> <p><i> Dette feltet skal kun rapporteres for flytende renteinstrumenter.</i></p> <p>Variabelen finnes i 'FloatingRateNote'-blokken i RPD-meldingen.</p>
BASIS POINT SPREAD	<p>Antall basispunkter som legges til eller trekkes fra på underliggende referanserente for å beregne den faktiske renten for en gitt periode ved utstedelse av instrument med flytende rente.</p> <p><i> Dette feltet skal kun rapporteres for flytende renteinstrumenter</i></p> <p>Variabelen finnes under 'FloatingRateNote'- blokken i RPD-meldingen.</p>

CALL OR PUT	<p>Angir om instrumentet har en kjøps- (call) eller salgsoption (put). Dersom instrumentet har både kjøps- og salgsoption skal begge opsjoner rapporteres.</p> <p><i>Dette feltet gjelder kun for instrumenter med kjøps- og/eller salgsoption.</i></p> <p><i>For instrumenter med kjøps- eller salgsoption skal minst ett av feltene FIRST CALL/PUT DATE eller CALL/PUT NOTICE PERIOD rapporteres.</i></p> <p>Variabelen finnes i 'CallPutOption'-blokken og heter 'Tp' i RPD-meldingen.</p>
FIRST CALL/PUT DATE	<p>Første dag for når kjøps- eller salgsoptionen kan innløses. Rapporteringen er obligatorisk for instrumenter med kjøps-/salgsoption som kan innløses på en eller flere forhåndsbestemte datoer.</p> <p><i>Dette feltet gjelder kun for instrumenter med kjøps- og/eller salgsoption.</i></p> <p>Variabelen står under 'CallPutOption'-blokken og heter 'EarlstExrcDt' i RPD-meldingen.</p>
CALL/PUT NOTICE PERIOD	<p>Antall kalenderdager i forveien som eieren av opsjonen må varsle innehaveren/utstederen av instrumentet før kjøp-/salgsoptionen innløses.</p> <p><i>Dette feltet gjelder kun for instrumenter med kjøps- og/eller salgsoption.</i></p> <p>Variabelen står under 'CallPutOption' –blokken og heter 'NtcePrd' i RPD-meldingen.</p>

3.3.2.2 Variabelkoder – usikret

Variabel	Variabelnavn	Type	Eksempel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (se vedlegg 1)	NEWT
U15	NOVATION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_NOVATION_STATUS (se vedlegg 1)	NOVA
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Streng. Maks Lengde: 105 Unique Transaction Identifier (UTI) Opp til 105 alfanumeriske tegn. 4 spesialtegn tillates ':', ',', '-', '_' Spesialtegn kan ikke brukes i start og slutt. Mellomrom kan ikke brukes.	

U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105. Unikt transaksjonsnummer per rapportør og markedssegment.	297bb268-28df-416c-bb1f-4d6202878f54
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Streng. Lengde: 20 Legal Entity Identifier (LEI) er en 20-sifret alfanumerisk kode som er unik for selskaper med virksomhet i finansmarkedene (ISO17442)	«549300GKFG0RYRRQ1414» refererer til DNB Bank ASA
U60	COUNTERPARTY SECTOR	Streng. Maks lengde: 4 Refererer til institusjonell sektor etter ESA 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se vedlegg 1)	«S11» refererer til "Ikke-finansielle foretak"
U70	COUNTERPARTY LOCATION	Streng. Lengde: 2 [ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se vedlegg 1)	«NO» refererer til Norge
U80	TRADE DATE	Dato/tid [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>eller</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Informasjon om tidssone (+/-hh:mm) skal inkluderes. Lokal tid uten «+/-hh:mm» er ikke tillat <i>Eller</i> Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26T09:00:00+00:00 refererer til 26. november 2014 kl. 9:00 (GMT) <i>Eller</i> 2014-11-26 refererer til 26. november 2014.
U90	SETTLEMENT DATE	Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
U100	MATURITY DATE	Date [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
U110	INSTRUMENT TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_INSTRUMENT_TYPE (se vedlegg 1)	'DPST' står for innskudd
U120	TRANSACTION TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (se vedlegg 1)	'BORR' står for innlån 'LEND' står for utlån

U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt tall. Desimaler: opp til 5 Valutakode [ISO 4127]	1 000 000 000 NOK, hvor 'NOK' står for norske kroner. Rapportert valuta skal alltid være norske kroner.
U140	TRANSACTION DEAL PRICE	Numerisk. Maks total lengde: 11 Desimaler: opp til 10 Enhet: Prosent	99.234 står for 99,234%
U150	RATE TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_RATE_TYPE (se vedlegg 1)	"VARI" står for flytende rente
U160	DEAL RATE	Numerisk. Maks total lengde: 11 Positive eller negative tall. Desimaler: opp til 10 Enhet: Prosent	10.234 for en rente på 10,234%.
U170	REFERENCE RATE INDEX	Streng. Lengde:12 ISIN-nummer [ISO6166] eller ISIN-kompatibel kode fra vedlegg 2	'NIBOR3M00009' står for Nibor 3 mnd.
U180	BASIS POINT SPREAD	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt eller negativt tall. Desimaler: 0 Enhet: Basispunkt	1023 for en spread på 10,234%. Ettersom enheten er basispunkter rundes 10.234 % ned til 10.23 % og deretter konvertert til 1023.
U190	CALL OR PUT	Streng. Lengde: 4 CL_CALL_PUT (se vedlegg 1)	'CALL' eller 'PUT'
U200	FIRST CALL/PUT DATE	Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 CET
U2010	CALL/PUT NOTICE PERIOD	Numerisk. Maks total lengde: 18 Desimaler: 0	7 står for en varslingsperiode/frist på én uke.

3.3.3 FX-swap

FX-swap omfatter transaksjoner hvor norske kroner selges/kjøpes mot utenlandsk valuta med avtale om å reversere salget/kjøpet på et avtalt fremtidig tidspunkt.

3.3.3.1 Variabeldefinisjoner – FX-swap

Tabellen under spesifiserer hver enkelt variabel som skal rapporteres for hver transaksjon. Noen variabler er valgfrie å rapportere (lyseblå felt). Det oppfordres til å rapportere alle variabler så langt det er mulig.

Variable name	Description
REPORTED TRANSACTION STATUS	Status for transaksjonen. Informasjon om transaksjonen er: <ul style="list-style-type: none"> - Ny - et tillegg til en tidligere rapportert transaksjon - en kansellering av en tidligere rapportert transaksjon - en korrigering av en tidligere rapportert transaksjon
NOVATION STATUS	Om transaksjonen er en novasjon (endring av transaksjonsmotpart)

	<i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt.</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Unik kode som identifiserer transaksjonen. <i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Bankens egen interne transaksjonskode. PTI-en må være unik per markedssegment og rapporteringsenhet
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Hvis transaksjonen er en novasjon rapporteres den opprinnelige PTI. <i>Rapporteres kun dersom det er aktuelt.</i>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	PTI som motparten angir i den samme transaksjonen. <i>Rapporteres kun dersom den er tilgjengelig</i>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Legal Entity Identifier (LEI) for motparten. For motparter som ikke har LEI skal «Counterparty Sector» og «Counterparty location» brukes i stedet.
COUNTERPARTY SECTOR	Angir den institusjonelle sektoren til motparten, for eksempel ikke-finansielle foretak, sentralbank osv. COUNTERPARTY SECTOR må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY IDENTIFICATION ikke rapporteres. Variabelen heter 'Sctr' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i medlingen.
COUNTERPARTY LOCATION	Angir landkoden (ISO) til landet der motparten er hjemmehørende. COUNTERPARTY LOCATION må oppgis for alle transaksjoner der COUNTERPARTY LOCATION ikke rapporteres. Variabelen heter 'Lctn' i RPD-meldingen og finnes i 'SectorAndLocation'-blokken i 'CounterpartyIdentification'-blokken i medlingen.
TRADE DATE	Dato og klokkeslett for når partene har inngått avtale om transaksjonen. Dersom klokkeslett ikke finnes rapporteres kun dato.
VALUE DATE	Angir oppgjørsgdato. For FX-swap er dette datoen for «near leg» Variabelen heter 'SpotValDt' i RPD-meldingen.
MATURITY DATE	Angir forfallsdato. For FX-swap er dette datoen for «far leg».
FX TRANSACTION TYPE	Angir om norske kroner selges eller kjøpes på oppgjørsgdatoen. Variabelen heter 'TxTp' i RPD-meldingen.
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Angir det nominelle beløpet i norske kroner som selges/kjøpes på oppgjørsgdatoen.
FOREIGN CURRENCY CODE	Angir den internasjonale ISO-koden for valutaen som kjøpes/selges mot norske kroner, for eksempel «EUR». Variabelen finnes i 'ForeignExchange'-blokken og heter 'FrgnCcy' i RPD-meldingen.
FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE	Angir valutakursen som ligger til grunn for det første beinet i swap-transaksjonen. Kursen skal uttrykkes som antall norske kroner per 1 enhet utenlandsk valuta.

	Variabelen finnes i 'ForeignExchange'-delen og heter 'XchgSpotRate' i RPD-meldingen.
FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS	Angir forskjellen mellom terminkursen og spotkursen uttrykt i pips: (Terminkurs – spotkurs)*10000 Variabelen finnes i 'ForeignExchange'-blokken og heter 'XchgFwdPt' i RPD-meldingen.

3.3.3.2 Variabelkoder – FX-swap

Variablene	Variable name	Type	Example
F10	REPORTED TRANSACTION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (se vedlegg 1)	NEWT
F15	NOVATION STATUS	Streng. Lengde: 4 CL_NOVATION_STATUS (se vedlegg 1)	NONO
F20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	Streng. Maks Lengde: 105 Unique Transaction Identifier (UTI) Opp til 105 alfanumeriske tegn. 4 spesialtegn tillates ':', ':', '-', '_' Spesialtegn kan ikke brukes i start og slutt. Mellomrom kan ikke brukes.	
F30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105. Unikt transaksjonsnummer per rapportør og markedssegment.	2b025687-f8b6-4848-bb4d-feaaafaaf07
F35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	
F40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	Streng. Maks lengde: 105.	
F50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Streng. Lengde: 20 Legal Entity Identifier (LEI) er en 20-sifret alfanumerisk kode som er unik for selskaper med virksomhet i finansielle markeder. (ISO17442)	«549300GKFG0RYRRQ1414» refererer til DNB Bank ASA
F60	COUNTERPARTY SECTOR	Streng. Maks lengde: 4 Refererer til institusjonell sektor etter ESA 2010. CL_COUNTERPARTY_SECTOR (se vedlegg 1)	«S11» refererer til "Ikke-finansielle foretak"
F70	COUNTERPARTY	Streng. Lengde: 2	«NO» refererer til Norge

	TY LOCATION	[ISO3166-1 alpha-2] CL_COUNTRY (se vedlegg 1)	
F80	TRADE DATE	Dato/tid [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>eller</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Informasjon om tidssone (+/-hh:mm) skal inkluderes. Lokal tid uten «+/- hh:mm» er ikke tillat <i>Eller</i> Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11- 26T09:00:00+00:00 refererer til 26. november 2014 kl. 9:00 (GMT) <i>Eller</i> 2014-11-26 refererer til 26. november 2014.
F90	VALUE DATE	Dato [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
F100	MATURITY DATE	Date [ISO 8601] YYYY-MM-DD Dato må samsvare med CET-tidssone.	2014-11-26 står for 26. november 2014 (CET)
F110	FX TRANSACTION TYPE	Streng. Lengde: 4 CL_FX_TRANSACTION_TYPE (se vedlegg 1)	'BUYI' står for norske kroner kjøpt i «near leg»
F120	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt tall. Desimaler: opp til 5 Valutakode [ISO 4127]	1 000 000 000 NOK, hvor 'NOK' står for norske kroner. Rapportert valuta skal alltid være norske kroner.
F130	FOREIGN CURRENCY CODE	Streng. Lengde: 3 [ISO 4217] CL_FCC (se vedlegg 1)	'USD' står for Amerikanske dollar
F140	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE	Numerisk. Maks total lengde: 11 Desimaler: opp til 10	8.2993 for en kurs på NOK 8,2993 per 1 USD.
F150	FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS	Numerisk. Maks total lengde: 18 Positivt eller negativt tall. Desimaler: opp til 17 (se vedlegg VI)	-350 dersom spotkursen for USDNOK er 8.2993 og terminkursen er 8.2634

Vedlegg 1: Kodeliste

Kodelistenavn	Input	Beskrivelse
CL_CALL_PUT	CALL	Call
	PUTO	Put
CL_FCC		Se ISO 4217
CL_CFI		Se ISO 10962
CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR	S11	Ikke-finansielle foretak
	S12	Finansielle foretak
	S121	Sentralbanker
	S122	Banker
	S123	Pengemarkedsfond (MMFs)
	S124	Andre verdipapirfond
	S125	Andre finansielle foretak
	S126	Øvrige finansielle foretak mv.
	S127	Statlige låneinstitutter mv.
	S128	Forsikringsforetak
	S129	Pensjonskasser
	S13	Offentlig forvaltning
	S14	Husholdninger
	S15	Ideelle organisasjoner
	CL_COLLATERAL_POOL	POOL
NOPL		Enkelt sikkerheter
CL_COUNTERPARTY_SECTOR	S11	Ikke-finansielle foretak
	S121	Sentralbanker
	S122	Banker
	S123	Pengemarkedsfond (MMFs)
	S124	Øvrige verdipapirfond
	S125	Andre finansielle foretak
	S126	Øvrige finansielle foretak mv.
	S127	Statlige låneinstitutter mv.
	S128	Forsikringsforetak
	S129	Pensjonskasser
	S13	Offentlig forvaltning
CL_COUNTRY		Se ISO 3166-1 alpha-2
CL_DATASETACTION	NOTX	Ingen transaksjon
CL_FX_TRANSACTION_TYPE	BUYI	Beløp NOK kjøpt på termin
	SELL	Beløp NOK solgt på termin

CL_INSTRUMENT_TYPE	DPST	Innskudd
	CEOD	Certificate of deposit (CD)
	COPR	Commercial paper (CP)
	ABCP	Asset backed commercial paper
	FRNT	Floating rate note (FRN)
	OTHR	Andre kortsiktige gjeldspapirer
CL_MARKET_SEGMENT	auth.012.001.02	Sikret segment
	auth.013.001.02	Usikret segment
	auth.014.001.02	FX-swap
CL_NOVATION_STATUS	NONO	Ingen novasjon
	NOVA	Novasjon
CL_RATE_TYPE	FIXE	Fastrente
	VARI	Flytende rente
CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS	AMND	Tillegg
	CANC	Kansellering
	CORR	Korreksjon
	NEWT	Ny transaksjon
CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR	GENE	Generelle sikkerheter (GC)
	SPEC	Spesielle sikkerheter
	MRRP	Verdipapirutlån (Sec lending)
CL_TRANSACTION_TYPE	BORR	Innlån
	LEND	Utlån

Vedlegg 2: Kodeliste for underliggende rente uten ISIN

Rente	Input (ISIN-kompatibel kode)
NOWA	NOWARATE0003
Nibor 1 uke	NIBOR1W00002
Nibor 1 mnd	NIBOR1M00003
Nibor 2 mnd	NIBOR2M00001
Nibor 3 mnd	NIBOR3M00009
Nibor 6 mnd	NIBOR6M00002
Styringsrente	NBFOLIO00005

Vedlegg 3: Eksempler på rapportering

Eksempel 1)

Gjenkjøpsavtale:

Rapportør: Bank A

Bank A låner NOK 500 mill og reper ut DNB Boligkreditt 12/14/27 til Bank B. Reporenten er 1,10 % pa. Obligasjonskursen inkludert påløpte renter er 97,39.

Handledato er 23. oktober 2018, oppgjør dato er 24. oktober 2018 og forfallsdato er 7. november 2018.

Bank A rapporterer følgende:

Variabelkode	Variabelnavn	Eksempel
S10	REPORTED TRANSACTION STATUS	NEWT
S15	NOVATION STATUS	NONO
S20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	
S30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	4ec4bf31-51ec-445b-90e5-d86fe93d65e6
S35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
S40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
S50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	<i>LEI-nummer for bank B</i>
S60	COUNTERPARTY SECTOR	
S70	COUNTERPARTY LOCATION	
S80	TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION	
S90	TRADE DATE	2018-10-23T10:00:00+00:00
S100	SETTLEMENT DATE	2018-10-24
S110	MATURITY DATE	2018-11-07
S120	TRANSACTION TYPE	BORR
S130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	486950000 NOK
S140	RATE TYPE	FIXE
S150	DEAL RATE	1.10
S160	REFERENCE RATE INDEX	
S170	BASIS POINT SPREAD	
S180	COLLATERAL ISIN	XS1735612290
S190	COLLATERAL POOL	
S200	COLLATERAL TYPE	
S210	COLLATERAL ISSUER SECTOR	
S220	SPECIAL COLLATERAL INDICATOR	GENE
S230	COLLATERAL NOMINAL AMOUNT	500000000 NOK
S240	COLLATERAL HAIRCUT	

Eksempel 2)

Innskudd:

Rapportør: Bank A

Bank A mottar et innskudd fra Bank B på NOK 500 millioner. Fast rente 0,81% pa. Handedato er 25. oktober 2018 og oppgjør dato er 25. oktober 2018.

Bank A rapporterer følgende:

Variabel	Variabelnavn	Eksempel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS	NEWT
U15	NOVATION STATUS	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	b995b5e7-0111-4a29-b92b-69e06946e618
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	LEI-nummer for Bank B
U60	COUNTERPARTY SECTOR	
U70	COUNTERPARTY LOCATION	
U80	TRADE DATE	2018-10-25T11:04:00+00:00
U90	SETTLEMENT DATE	2018-10-25
U100	MATURITY DATE	2018-10-26
U110	INSTRUMENT TYPE	DPST
U120	TRANSACTION TYPE	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	500000000 NOK
U140	TRANSACTION DEAL PRICE	100
U150	RATE TYPE	FIXE
U160	DEAL RATE	0.81
U170	REFERENCE RATE INDEX	
U180	BASIS POINT SPREAD	
U190	CALL OR PUT	
U200	FIRST CALL/PUT DATE	
U2010	CALL/PUT NOTICE PERIOD	

Eksempel 3)

Innskudd med 31-dagers varslingsfrist for uttak:

Bank A mottar et innskudd fra Bedrift A på NOK 300 millioner. Innskuddet kan tas ut tidligst 31 dager etter varslingsfrist. Fast rente 1,00% pa. Handedato er 25. oktober 2018 og oppgjør dato er 25. oktober 2018.

Bank A rapporterer følgende:

Variabel	Variabelnavn	Eksempel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS	NEWT
U15	NOVATION STATUS	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	0a67ebb0-ed7b-431e-b336-5642a1715f53
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	
U60	COUNTERPARTY SECTOR	S11
U70	COUNTERPARTY LOCATION	NO
U80	TRADE DATE	2018-10-25T11:04:00+00:00
U90	SETTLEMENT DATE	2018-10-25
U100	MATURITY DATE	2018-11-23
U110	INSTRUMENT TYPE	DPST
U120	TRANSACTION TYPE	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	300000000 NOK
U140	TRANSACTION DEAL PRICE	100
U150	RATE TYPE	FIXE
U160	DEAL RATE	0.1
U170	REFERENCE RATE INDEX	
U180	BASIS POINT SPREAD	
U190	CALL OR PUT	
U200	FIRST CALL/PUT DATE	
U2010	CALL/PUT NOTICE PERIOD	

Eksempel 4)

FX-swap

Rapportør: Bank A

Bank A selger selger NOK 300 millioner vs USD til Bank B. Handedato 22. mai 2018, oppgjør dato 23. mai 2018 og forfall 23. august 2018. USDNOK spotkurs er 8,0607 og USDNOK terminpunkter er -283,86.

Bank A rapporterer følgende:

Variable	Variable name	Eksempel
F10	REPORTED TRANSACTION STATUS	NEWT
F15	NOVATION STATUS	NONO
F20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER	
F30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	f9657dd1-6018-4eee-9078-f4b4360f318f
F35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
F40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	
F50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	LEI-nummeret til Bank B
F60	COUNTERPARTY SECTOR	
F70	COUNTERPARTY LOCATION	
F80	TRADE DATE	2018-05-22T10:00:00+00:00
F90	VALUE DATE	2018-05-23
F100	MATURITY DATE	2018-08-23
F110	FX TRANSACTION TYPE	SELL
F120	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	300000000 NOK
F130	FOREIGN CURRENCY CODE	USD
F140	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE	8.0607
F150	FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS	-286.86

Vedlegg 4: Mapping av ORBOF-koder og S-koder

S-navn	S-kode	ORBOF-kode	ORBOF-navn
Ikke-finansielle foretak	S11	21000	Private aksjeselskaper mv.
		11200	Statlig eide aksjeselskaper mv.
		15200	Kommunalt eide aksjeselskaper mv.
		23000	Personlige foretak
		11100	Statens forretningsdrift
		15100	Kommunale foretak med ubegrenset ansvar
		25000	Private, produsentorienterte organisasjoner uten profittformål
		91000	Utenlandske ikke-finansielle foretak
Sentralbanker	S121	92000	Utenlandske sentralbanker
Banker	S122	32000	Banker
		35000	Kredittforetak
		93000	Utenlandske kredittinstitusjoner
Pengemarkedsfond	S123	43000	Verdipapirfond*
Øvrige verdipapirfond	S124	43000	Verdipapirfond
Andre finansielle foretak	S125	36000	Finansieringsselskaper
		45000	Investeringselskaper og aktive eierfond / PE-fond
		95000	Utenlandske andre finansielle foretak

Øvrige finansielle foretak mv.	S126	41000	Finansielle holdingsselskaper
		49000	Øvrige finansielle foretak unntatt forsikring
Statlige låneinstitutter mv.	S127		
		39000	Statlige låneinstitutter mv.
Forsikringsforetak	S128	55000	Livsforsikringsselskaper mv.
		57000	Skadeforsikringsselskaper
Pensjonskasser	S129	55000	Livsforsikringsselskaper mv.**
Offentlig forvaltning	S13	61000	Stats- og trygdeforvaltningen
		65000	Kommuneforvaltningen
		96000	Utenlandsk offentlig forvaltning

*Som er pengemarkedsfond

**Som er pensjonskasser

Vedlegg 5: Kontaktskjema overnattentransaksjoner

Rolle	Telefonnummer	E-post	Navn

En kontakt kan være en enkeltperson eller en fellespostkasse eller lignende.