

**Varedeklaration: Renter og kurser**

- ▶ [0 Administrative oplysninger om statistikproduktet](#)
- ▶ [1 Indhold](#)
- ▶ [2 Tid](#)
- ▶ [3 Pålidelighed og usikkerhed](#)
- ▶ [4 Sammenlignelighed](#)
- ▶ [5 Tilgængelighed](#)
- ▶ [6 Supplerende dokumentation](#)

**0 Administrative oplysninger om statistikproduktet****0.1 Navn**

Renter og kurser.

**0.2 Emnegruppe**

Renter  
Valutakurser  
Penge- og kapitalmarked.

**0.3 Ansvarlig myndighed, kontor, person m.v.**

*Danmarks Nationalbank, Statistisk Afdeling, Publikationssektionen*  
Anne-Marie Mortensen, tlf. 33 63 68 44, e-post: amm@nationalbanken.dk  
Anja Krøyer Kristoffersen, tlf. 33 63 68 64, e-post: akr@nationalbanken.dk

**0.4 Formål og historie**

Statistikken bruges som referenceramme ved indgåelse af aftaler indeholdende veksling af valuta og/eller rentebærende aktiver og passiver.

Nationalbanken har historisk indsamlet oplysningerne.

**0.5 Brugere og anvendelsesområder**

Pengeinstitutter, andre finansielle virksomheder, ikke-finansielle virksomheder, privatpersoner, interesseorganisationer.

**0.6 Kilder**

Nationalbanken.

**0.7 Indsamlingshjemmel**

Nationalbanken indsamler oplysningerne i medfør af [Nationalbanklovens §14 a](#) indsat ved lov nr. 579 af 1. juni 2010 ifølge hvilken Nationalbanken indsamler, bearbejder og offentliggør statistiske oplysninger indenfor dens kompetenceområde. De indsamlede oplysninger kan anvendes til andet end statistikudarbejdelse. Det gælder særligt i forbindelse med overvågningen af den finansielle stabilitet og ved tilrettelæggelsen af penge- og valutapolitikken, samt i relation til Nationalbankens deltagelse i det europæiske samarbejde på det finansielle område. Se endvidere notat [Ny statistikhjemmel i nationalbankloven](#).

**0.8 Respondentbyrde**

Ingen – indsamlingen sker som led i Nationalbankens almindelige virke.

**0.9 EU-regulering**

Ingen.

**1 Indhold****1.1 Indholdsbeskrivelse**

Statistikken indeholder de officielle rentesatser og valutakurser fastsat af Nationalbanken eller observeret på pengemarkedet.

**1.2 Statistiske begreber**

*Foliokonti*

På foliokonti indsætter pengeinstitutterne overskydende likviditet på anfordring.

**Henvendelse:**

**Danmarks Nationalbank  
Statistisk Afdeling  
Publikationssektionen**

Anne-Marie Mortensen  
☎ 33 63 68 44  
e-post: amm@nationalbanken.dk

Anja Krøyer Kristoffersen  
☎ 33 63 68 64  
e-post: akr@nationalbanken.dk

*Indskudsbeviser*

Indskudsbeviser, som normalt sælges sidste bankdag i ugen og har en løbetid på 7 dage, bærer ikke rente, men sælges til underkurs, således at det implicite afkast udgør indskudsbevisrenten. Ved annoncerede tilbagekøb af indskudsbeviser beregner Nationalbanken sig normalt et beskedent rentetilæg i forhold til de viste satser.

*Udlånsforretninger*

I de ugentlige markedsoperationer kan modparterne låne i 7 dage mod sikkerhed [eller placere likviditet i 7 dage ved køb af indskudsbeviser]. I de månedlige markedsoperationer kan modparterne låne i 6 måneder mod sikkerhed. Renten på 6-måneders udlån er variabel, fastsat til Nationalbankens 7-dages udlånsrente.

*Pengemarkedsrenter*

Tomorrow/next-renten er en interbank-sats for usikrede pengemarkedsudlån beregnet som et omsætningsvægtet gennemsnit af 12 indberetteres satser.

Danske 3-måneders pengemarkedsrenter, som betegner renter tilbudt for pengemarkedsindskud (bid-satser), indsamles kl. 11.00 hver bankdag; den sikrede sats er baseret på genkøbsforretninger i statspapirer. Dvs. lån mod sikkerhed (repo). Fra efteråret 2008 har den usikrede sats svinget betydeligt på grund af en beskeden omsætning i markedet.

CIBOR (Copenhagen InterBank Offered Rates) er en referencerente for afgivelse af likviditet på usikret basis på interbank-markedet til pengeinstitutter med høj kreditværdighed og beregnes på basis af de 12 største danske bankers kvoteringer kl. 10.30 hver bankdag.

3-måneders renter i udvalgte lande er pengemarkedssatser, som indsamledes af Nationalbanken hver bankdag kl. 11.00. Indsamlingen ophørte ultimo august 2011.

*Swap-referencerenter*

Swap-referencerenter afspejler renteniveauet i forbindelse med renteswaps, dvs. kontrakter på bytte af rentebetalinger i samme valuta – fra variabel til fast rente eller omvendt. Beregningen foretages dagligt på basis af 4 danske og 3 udenlandske pengeinstitutters kvoteringer kl. 11.00 og repræsenterer den faste rente for løbetider mellem 2 og 10 år mod swap fra/til 6 måneders CIBOR-rente. For en mere udførlig beskrivelse se følgende link:  
<http://www.finansraadet.dk/danish/menu/faktaomsektoren/SWAP+Reference+Fixing/>

*Obligationsrenter*

Effektive obligationsrenter er baseret på den til enhver tid toneangivende obligation i det pågældende segment. Den effektive gennemsnitlige obligationsrente beregnes på grundlag af samtlige statsobligationer og et udvalg af realkreditobligationer.

*Valutakurser*

De viste valutakurser afspejler markedskurserne kl. 14.15 fra og med januar 2002. Indtil udgangen af december 2001 afspejledes markedskurserne kl. 11.30. De anvendte betegnelser er de internationale ISO-koder og dækker over følgende valutaer:

AUD:	Australske dollar	XDR:	SDR	HRK:	Kroatiske kuna
CZK:	Tjekkiske koruna	CHF:	Schweizerfranc	RUB:	Russiske rubler
GBP:	Britiske pund	EUR:	Euro	THB:	Thailandske baht
ISK:	Islandske kroner	HUF:	Ungarske forint	MYR:	Malaysiske ringgit
(ISK er blevet suspenderet fra og med 10/12-08)					
LVL:	Lettiske lats	LTL:	Litauiske litas	PHP:	Filippinske pesos
PLN:	Polske zloty	NZD:	Newzealandske dollar	IDR:	Indonesiske rupiah
USD:	US-dollar	SGD:	Singapore dollar	CNY:	Kinesiske yuan renminbi
CAD:	Canadiske dollar	BGN:	Bulgarske lev	BRL:	Brasilianske real
HKD:	Hongkong dollar	RON:	Rumænske lei	MXN:	Mexikanske peso
JPY:	Japanske yen	TRY:	Tyrkiske lira	INR:	Indiske rupier
NOK:	Norske kroner	KRW:	Syd-koreanske won	ILS:	Israelske shekel
SEK:	Svenske kroner	ZAR:	Sydafrikanske rand		

*Nominel effektiv kronekurs*

Indekset for den nominelle effektive kronekurs er en geometrisk sammenvejning af udviklingen i 27 af Danmarks vigtigste handelspartners valutaer over for den danske krone, og beregningen foretages på basis af valutakurserne kl. 14.15 hver bankdag. Fra april 2010 er vægtgrundlaget baseret på industrivarehandelen i 2009, og tidligere på industrivarehandelen i 2002. De anvendte forbrugerprisindeks er nationale indeks beregnet af de nationale statistikbureauer.

I beregningen af forbrugerpriser i udlandet samt den reale effektive kronekurs baseret på henholdsvis forbrugerpriser og timelønninger indgår kun 25 lande.

En stigning i et kronekursindeks er udtryk for en nominel eller real appreciering af kronen.

*Aktieindeks*

Totalaktieindekset (OMXC) omfatter alle danske aktier noteret på Københavns Fondsbørs (OMX Exchanges, Copenhagen). For at undgå dobbeltregning medtages dog ikke investeringsforeninger samt et par holdingselskaber, hvis væsentligste aktivitet er helt eller delvis at eje andre børsnoterede selskaber.

OMXC20-indekset er en aktivportefølje bestående af 20 af de største og mest omsatte danske aktier.

## 2 Tid

### 2.1 Referencetid

Statistikken opgøres dagligt, månedlig og årligt. Enkelte kurser opgøres endvidere på kvartalsbasis.

### 2.2 Udgivelsestid

Data opdateres dagligt.

#### *For renter*

Månedssdata offentliggøres 2. bankdag efter månedsafslutning.

Årsdata offentliggøres 2. bankdag efter årets afslutning.

Kvartalsdata offentliggøres 2. bankdag efter kvartalets afslutning.

#### *For valutakurser*

Månedssdata offentliggøres 1. bankdag efter månedsafslutning.

Årsdata offentliggøres 1. bankdag efter årets afslutning.

Kvartalsdata offentliggøres 1. bankdag efter kvartalets afslutning.

### 2.3 Punktlighed

Statistikken offentliggøres til annonceret tid.

### 2.4 Hyppighed

Der offentliggøres nye tal ved hver offentliggørelse uanset frekvens.

## 3 Pålidelighed og usikkerhed

### 3.1 Samlet pålidelighed

Høj. Nationalbanken offentliggør de officielle tal for både rentesatser og valutakurser.

### 3.2 Usikkerhedskilder

Ingen.

### 3.3 Tal for usikkerhed

Der foretages ingen usikkerhedsberegning.

## 4 Sammenlignelighed

### 4.1 Sammenlignelighed over tid

Der findes ikke tidligere opgørelser.

### 4.2 Sammenlignelighed med anden statistik

Kan sammenlignes med andre centralbankens valutakurser.

### 4.3 Forhold mellem foreløbige og endelige tal

Der offentliggøres kun endelige tal.

## 5 Tilgængelighed

### 5.1 Distributionskanaler

[www.nationalbanken.dk](http://www.nationalbanken.dk) (under Statistik)

[nationalbanken.statistikbank.dk](http://nationalbanken.statistikbank.dk)

[www.statistikbanken.dk](http://www.statistikbanken.dk)

Årbog: Beretning og regnskab. Kbh., Danmarks Nationalbank.

**5.2 Grundmateriale: Lagring og anvendelsesmuligheder**

Materialet lagres i Statistisk Afdelings database.

**5.3 Dokumentation**

[Kilder og metode.](#)

**5.4 Øvrige oplysninger**

Ingen.

**6 Supplerende dokumentation**

Ingen.

04-10-2011