

Sekretariat og Kommunikation  
Publicering, Kommunikation

Senest revideret:  
11-09-2017

## Renter og valutakurser

- 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 valutakurser.

#### 0.2 Emnegruppe

Rentestatistik  
Valutakurser  
Penge- og kapitalmarked.

#### 0.3 Ansvarlig myndighed, kontor, person mv.

Danmarks Nationalbank, Sekretariat og Kommunikation, Publicering  
Kommunikation, tlf. 33 63 70 00, e-mail: [kommunikation@nationalbanken.dk](mailto:kommunikation@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**

Indsamles som led i Nationalbankens almindelige virke.

## **0.8 Respondentbyrde**

Ingen – indsamles 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.

### *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 implicitte afkast udgør indskudsbevisrenten. Ved annoncerede tilbagekøb af indskudsbeviser beregner Nationalbanken sig normalt et beskedent rentetillæg 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 indberettes satser.

### *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:

<b>Euro</b>	EUR	<b>Kroatiske kuna</b>	HRK
<b>Amerikanske dollar</b>	USD	<b>Malaysiske ringgit</b>	MYR
<b>Britiske pund</b>	GBP	<b>Mexicanske peso</b>	MXN
<b>Australske dollar</b>	AUD	<b>New Zealandske dollar</b>	NZD
<b>Brasilianske real</b>	BRL	<b>Poliske zloty</b>	PLN
<b>Bulgarske lev</b>	BGN	<b>Rumænske lei</b>	RON
<b>Canadiske dollar</b>	CAD	<b>Russiske rubel</b>	RUB
<b>Filipinske peso</b>	PHP	<b>Singapore dollar</b>	SGD
<b>Hongkong dollar</b>	HKD	<b>Japanske yen</b>	JPY
<b>Indiske rupee</b>	INR	<b>Sydafrikanske rand</b>	ZAR
<b>Indonesiske rupiah</b>	IDR	<b>Sydkoreanske won</b>	KRW
<b>Israelske shekel</b>	ILS	<b>Thailandske baht</b>	THB
<b>Svenske kroner</b>	SEK	<b>Tjekkiske koruna</b>	CZK
<b>Norske kroner</b>	NOK	<b>Tyrkiske lira</b>	TRY
<b>Schweiziske franc</b>	CHF	<b>Ungarske forint</b>	HUF
<b>Kinesiske yuan renminbi</b>	CNY	<b>SDR</b>	XDR

#### *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 januar 2015 er vægtgrundlaget baseret på industrivarehandlen i 2014. 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.

## **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**

Offentliggøres på:

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

<http://nationalbanken.statistikbank.dk> - for renter

<http://nationalbanken.statistikbank.dk> - for valutakurser

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

Se også Danmarks Nationalbank, [Beretning og regnskab](#).

Diverse historiske rentesatser kan findes på [Arkiv DNRENTD.csv](#)

### **5.2 Grundmateriale: Lagring og anvendelsesmuligheder**

Materialet lagres i Nationalbankens statistisk afdelings database.

### **5.3 Dokumentation**

Ingen.

### **5.4 Øvrige oplysninger**

Ingen.

## **6 Supplerende dokumentation**

Ingen.