

## Arbetsgruppen för alternativa räntor 2019-12-03

### Deltagare

Johan Bergström, Riksgälden  
Kåre Boström, LF-Bank  
Christer Frestadius, SBAB  
Magnus Karlsmyr, SHB  
Anders Kvist, Finansinspektionen  
Carl Milton, Danske  
Björn Pantzar, SEB  
Christian Perers, Nordea  
Johan Stefenson, SwB  
Amelie Stierna, Riksbanken  
Jonny Sylvén, Bankföreningen

### 1. Godkännande av agenda

Agendan godkändes.

### 2. Godkännande av tidigare protokoll

Protokollet från tidigare möte godkändes.

### 3. Slutsatser om konsultation 2

Dokumentet för slutsatser kring konsultation 2 diskuterades på mötet. Planen är att detta dokument ska publiceras senare denna vecka.

### 4. Fixingprocessen

Ett utkast till ett ramverk för fixingprocessen har tagits fram. Ramverket följer samma struktur som fixingprocessen har diskuterats utifrån sedan i våras. Vissa av de utestående frågorna kring utformningen av detta ramverk diskuterades på detta möte men övriga frågor kommer att diskuteras framöver med målsättningen att ha dokumentet klart för publicering till årsskiftet.

## 5. Namnfrågan

På mötet diskuterades olika aspekter på frågan om vad den nya räntan ska kallas. Det diskuterades om det fanns risker med att namnen på räntorna är så lika varandra, vilket det antagligen inte är. Det diskuterades även om det var bra att namnge räntan till något som innehöll begreppet för löptiden (Overnight) när räntan vanligen kommer att användas på längre löptider i olika sammanräknade varianter. Eftersom det redan är så vanligt hos RFR-räntor så antogs det inte heller ha någon större betydelse.

## 6. Kontakt med andra

-

## 7. Övriga frågor

Den danska tillsynsmyndigheten har släppt två skrivningar om övergången till en ny RFR och om riskerna med detta. Det är nu publikt att det skett en valutaswap i EYUR/USD som bara har referenser till RFR (€str/SOFR). Affären gjordes mellan Goldman och Morgan Stanley. Detta kan ses som att övergång till RFR i valutaswap-led, vilket AGAR har sagt kommer vara en av kanalerna för att sprida RFR, är igångsatt. I Riksbanksutredningen finns skrivningar som kommer att skapa ett starkare och mer explicit lagstöd för Riksbanken att administrera en ny referensränta.

## 8. Nästa möte

Nästa möte blir den 10 december kl. 14.00 i Bankföreningens lokaler.