

REGEL FÖR HANTERING AV RIKSBANKENS VÄRDEPAPPERSPORTFÖLJ I SVENSKA KRONOR

BESLUTSDATUM:	2023-12-14
BESLUT AV:	Direktionen
ANSVARIG AVDELNING:	Avdelningen för verksamhetssupport
FÖRVALTNINGSANSVARIG:	Riskchefen
DIARIENUMMER:	2023-01378
HANTERINGSKLASS:	ÖPPEN

Regel för hantering av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor

Innehåll och syfte

Denna regel innehåller kompletterande riktlinjer till *Finansiell risk- och investeringspolicy* och fastställer ramarna för hanteringen av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor som förvaltas av Avdelningen för marknader (AFM).

Målgrupp

Medarbetare med direkt eller indirekt koppling till förvaltningen av Riksbankens finansiella tillgångar och skulder.

Innehållsförteckning

Regel för hantering av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor	1
Innehåll och syfte	1
Målgrupp	1
1 Inledning	3
1.1 Bakomliggande regelverk	3
1.2 Definitioner	Fel! Bokmärket är inte definierat.
2 Roller och ansvar	3
3 Regler	3
3.1 Tillåtna tillgångsslag	3
3.2 Maximalt tillåtet innehav	3
3.3 Tillåtna transaktioner	3
3.4 Riskhantering	3
4 Efterlevnad	4
5 Ikraftträdande och övergångsbestämmelser	4

1 Inledning

1.1 Bakomliggande regelverk

- Finansiell risk- och investeringspolicy
- Lag (2022:1568) om Sveriges riksbank (riksbankslagen)

2 Roller och ansvar

Chefen för AFM ska inom ramen för reglerna i punkt 3 besluta om värdepappersportföljens närmare utformning och förvaltning.

3 Regler

3.1 Tillåtna tillgångsslag

- Tillgångarna i värdepappersportföljen i svenska kronor ska utgöras av de värdepapper Riksbanken köper inom ramen för direktionens penningpolitiska beslut.

3.2 Maximalt tillåtet innehav

- Maximalt tillåtet innehav av värdepapper i portföljen beslutas av direktionen inom ramen för penningpolitiska beslut.

3.3 Tillåtna transaktioner

- Transaktioner i tillåtna tillgångar ska ske i enlighet med vad som beslutas av direktionen inom ramen för penningpolitiska beslut.
- Transaktioner i företagsobligationer om de sker för att hantera företagshändelser reglerade i obligationsvillkoren, så kallade Corporate actions och andra av obligationsvillkoren tvingande händelser.

3.4 Riskhantering

- Riskerna i värdepappersportföljen ska hanteras i enlighet med vad som beslutas av direktionen inom ramen för penningpolitiska beslut. Övrig riskhantering ska ske i enlighet med Regel för guld- och valutareserven inom tillämpliga områden.
- Beslut om väsentliga förändringar av innehaven i Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor bereds av samtliga berörda avdelningar inom ramen för penningpolitiska beslut. I denna beredning ska även hänsyn tas till förändringens påverkan på de sammantagna riskerna på Riksbankens balansräkning.

4 Efterlevnad

Berörd avdelningschef ansvarar för att denna regel genomförs och efterlevs inom deras respektive avdelning. Riskenheten ansvarar för att följa upp efterlevnaden och att rapportera denna till direktionen.

5 Ikraftträdande och övergångsbestämmelser

Denna regel träder i kraft den 1 januari 2024 och ersätter *Regel för hantering av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor* som beslutades den 19 december 2022 (dnr 2022-01391).