



SVERIGES RIKSBANK
SE-103 37 Stockholm
(Brunkebergstorg 11)

Tel +46 8 787 00 00
Fax +46 8 21 05 31
registratorn@riksbank.se
www.riksbank.se

DNR 2019-01125

Regler

BESLUTSDATUM: 2019-12-02
BESLUT AV: Direktionen
ANSVARIG AVDELNING: Stabsavdelningen/Riskenheten
FÖRVALTNINGSANSVARIG: Riskchefen

Regler om förvaltning av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor

1. Syfte

Dessa förvaltningsregler fastställer ramarna för förvaltningen av Riksbankens värdepappersportfölj i svenska kronor inom AFM.

2. Tillåtna tillgångsslag

Tillgångarna i värdepappersportföljen ska utgöras av de obligationer som Riksbanken köper inom ramen för direktionens penningpolitiska beslut.

3. Maximalt tillåtet innehav

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

4. Tillåten ränterisk

Värdepappersinnehavets räntekänslighet, mätt som modifierad duration, ska hållas inom intervallet 0,0 till 30,0.

5. Tillåtna transaktioner

Transaktioner i tillåtna tillgångar ska ske i enlighet med vad som beslutas av direktionen inom ramen för penningpolitiska beslut.

6. Riskhantering

Tillåtna transaktioner i tillåtna tillgångar ska ske i enlighet med Riksbankens finansiella risk- och investeringspolicy och Regler för guld- och valutareserven med undantag för avsnitt 3 (Policyportfölj), 4 (Tillåtna avvikelser från policyportföljen och 5 (Valutalån)



7. Övrigt

Det ankommer på AFM att besluta om värdepappersportföljens närmare utformning och förvaltning.