



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

Förslag till beslut

DATUM: 2012-11-27
AVDELNING: STA/RIE
HANDLÄGGARE: Tomas Edlund
HANTERINGSKLASS

■ Den finansiella riskpolicyn och direktionens riskregler

Förslag till beslut

Direktionen föreslås besluta att fastställa:

- finansiella riskpolicyn, bilaga 1
- direktionens regler för kreditrisk, bilaga 2
- direktionens regler för likviditetsrisk, bilaga 3
- direktionens regler för marknadsrisk, bilaga 4
- direktionens placeringsregler, bilaga 5

Bakgrund

Riskenheten ska enligt Riksbankens instruktion lägga fram förslag till direktionen om finansiell riskpolicy och dess underliggande riskregler. I bilagda dokument återfinns förslagen.

Sammanfattning

Riskenheten föreslår ett antal förändringar i syfte att förtydliga. De *viktigaste* förändringsförslagen som påverkar riskmandatet är

- Obegränsad limit för emittenten USA obetingat dess kreditbetyg (Direktionens regler för kreditrisk 5.1).
- Införandet av en koncentrationslimit som begränsar den sammanlagda avvecklingsexponeringen (Direktionens regler för kreditrisk 4.6).
- Borttagande av explicita limiter för den sammanlagda nettoexponeringen mot motparter och emittenter med hemvist i samma land (Direktionens regler för kreditrisk).
- Höjda koncentrationslimiter för emittenter och motparter med lägre kreditbetyg (Direktionens regler för kreditrisk 4.1-4.5).