

K52013-02-22

FINANSIELL RISKRAPPORT 2013-01-31

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2013-02-22

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

	Bokföringsdatum			Skulder((finansiering)	Bokföringsdatum		
	13-01-31	12-12-31	11-12-31		13-01-31	12-12-31	11-12-31
Reverser Telge	11 558	11 528	11 420	Certifikat, KC-programmet	2 400	2 200	0
Reverser Söderenergi	723	723	714	Obligationer, MTN-progr.	3 187	3 189	2 310
Reverser Fotbollsarenan	85	85	86	Övriga obligationer	3 637	3 637	3 168
Reverser SSK Arena	65	65	53	Lån från Kommuninvest	200	200	0
Reverser Tälgehallen	29	29	0	Banklån	2 341	2 488	5 676
Reverser andra komm.	0	0	0	Lån från andra kommuner	0	0	0
Övriga kortfr plac.	46	0	92	Kreditfaciliteter	0	0	0
				Lån från kommunens likv.	742	718	1211
Summa IBs tillgångar	12 506	12 430	12 365	Summa IBs skulder	12 506	12 430	12 365

KOMMUNKONCERNENS BETALNINGSBEREDSKAP [Mkr]

	Avtalsbelopp	Utnyttjat	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt
Checkkrediter	600	0	600	Ja
Kreditlöften	2 500	0	2 500	Ja
Totalt	3 100	0	3 100	

KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

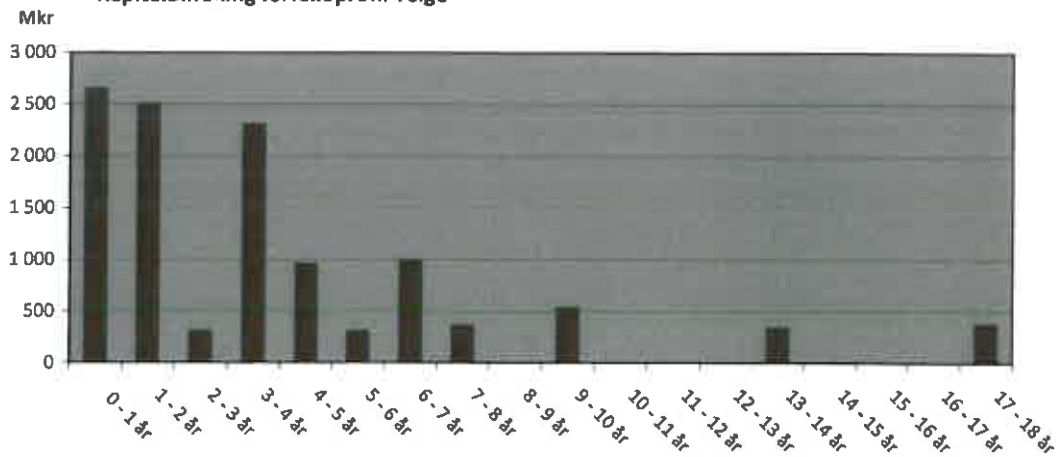
	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	2 400	1 600
MTN-obligationer	5 000	3 187	1 813
Totalt	9 000	5 587	3 413

FINANSIERINGSRISK

Kommunkoncernen			
Gömsnittlig kapitalbind.tid	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
3,8	4 år	3 - 5 år	Ja
LCR*	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
93%	80%	≥ 70%	Ja

* LCR = Betalningsberedskap/Kapital som förfaller inom 12 månader

Kapitalbindning förfalloprofil Telge



MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

Portfölj	MV	MV, föreg mån	Nom. Belopp
Telge	-316,6	-340,2	12 846
SÖEN	-222,2	-264,9	1 932
Totalt	-538,8	-605,1	14 778

Molpartsrisk - totalt i kommunens namn

Exponeringen för molpartsrisk på samtliga ingångna derivat i Södertälje kommuns namn följer de riktlinjer som anges i kommunens "Finansiella instruktioner".

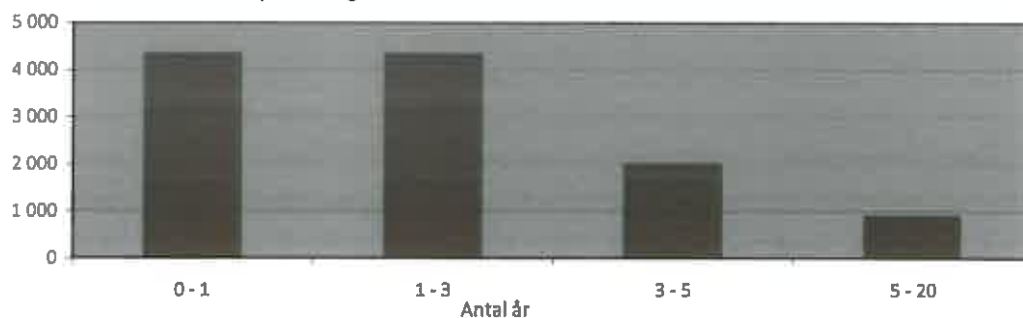
RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Ränte-bindning	Mkr	%-andel av total skuld	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
0 - 1	4 337	38%	45%	35% - 55%	Ja
1 - 3	4 325	37%	45%	35% - 55%	Ja
3 - 5	2 000	17%	10%	0% - 20%	Ja
5 - 20	896	8%	0%	0 - 15%	Ja
Totalt	11 558	100%	100%		

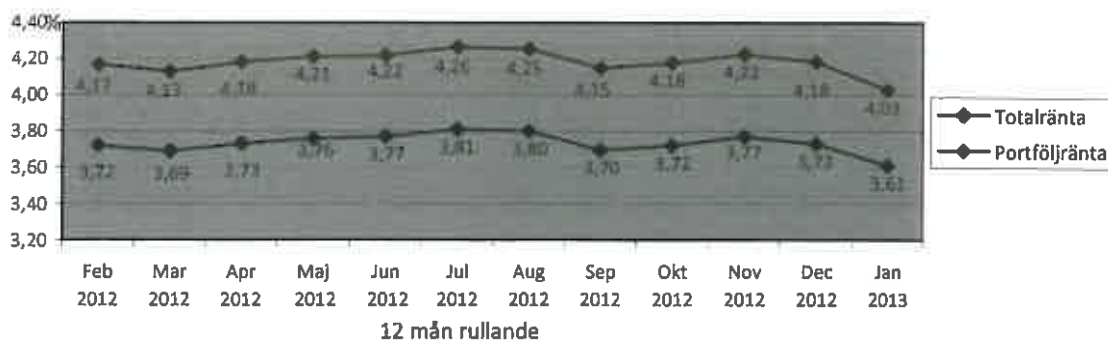
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telge	2013-01-31	Ack. 2013	Prognos 2013
Portföljränta	31,8	31,8	411,8
Finansiella administrativa kostnader	0,5	0,5	6,4
Borgensavgift	3,5	3,5	42,6
Totalt	35,8	35,8	460,8

Preliminära värden



FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2013-01-31 Ack. 2013	
Borgensintäkter	3,9	3,9
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,2	0,2
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SOEN	3,4	3,4
Totalt	7,6	7,6

Kommunens kostnader	2013-01-31 Ack. 2013	
Alternativkostnad för räntefria lån enl. särsk. beslut	-0,3	-0,3

UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENSRAMAR [Mkr]

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Bokföringsdatum
			Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 706,6	793,4
varav Syvab	124,6	115,2	9,4
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 396,7	199,3
varav Fotbollsarenan AB	85,3	85,3	0,0
varav SSK Arena AB	83,0	65,0	18,0
varav Tälgehallen AB	33,2	29,2	4,0
varav övrig kommunal borgen	15,9	15,2	0,7
Telgekoncernen hel- och delägda bolag	13 300,0	12 922,3	377,7
varav lån via Internbanken		11 558,0	
varav borgen Telge Kraft		752,2	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		45,8	
Total	15 800,0	14 628,9	1 171,1

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	31,7

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	12-01-31	12-12-31	13-01-31	14-02-05
Stibor 3M	2,57	1,29	1,18	1,36
Swap 2 år	1,85	1,22	1,35	1,71
Swap 5 år	2,00	1,52	1,87	2,18
Swap 10 år	2,34	2,03	2,39	2,60

