

KS20130402

FINANSIELL RISKRAPPORT 2013-02-28

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2013-04-02

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

	13-02-28			13-01-31			12-12-31			Bokföringsdatum		
	13-02-28	13-01-31	12-12-31	Skulder (finansiering)	13-02-28	13-01-31	12-12-31	13-02-28	13-01-31	12-12-31		
Placering Telge	11 582	11 616	11 714	Certifikat, KC-programmet	2 450	2 400	2 200					
Reverser Söderenergi	708	723	723	Obligationer, MTN-progr.	2 889	3 187	3 189					
Reverser Fotbollsarenan	85	85	85	Övriga obligationer	3 637	3 637	3 637					
Reverser SSK Arena	65	65	65	Lån från Kommuninvest	200	200	200					
Reverser Tälgehallen	29	29	29	Banklån	2 341	2 341	2 488					
Reverser andra komm.	0	0	0	Lån från andra kommuner	0	0	0					
Övriga kortfr plac.	46	46	0	Kreditfaciliteter	0	0	0					
				Lån från kommunens llkv.	1 000	800	904					
Summa IBs tillgångar	12 516	12 564	12 616	Summa IBs skulder	12 516	12 564	12 616					

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]

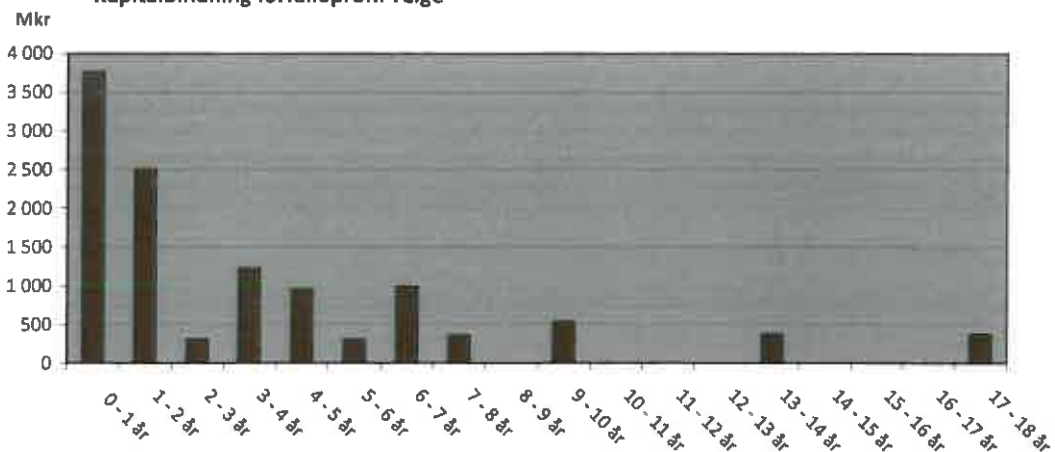
	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	2 450	1 550
MTN-obligationer	5 000	2 889	2 112
Totalt	9 000	5 339	3 662

FINANSIERINGSRISK

Telge och kommunen			
Genomsnittlig kapitalbind.tid	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
3,5	4 år	3 - 5 år	Ja
LCR*	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
95%	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	-347,8	-316,6	13 046
SÖEN	-224,1	-222,2	1 932
Totalt	-571,9	-538,8	14 978

Motpartsrisk - Totalt i kommunens namn

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

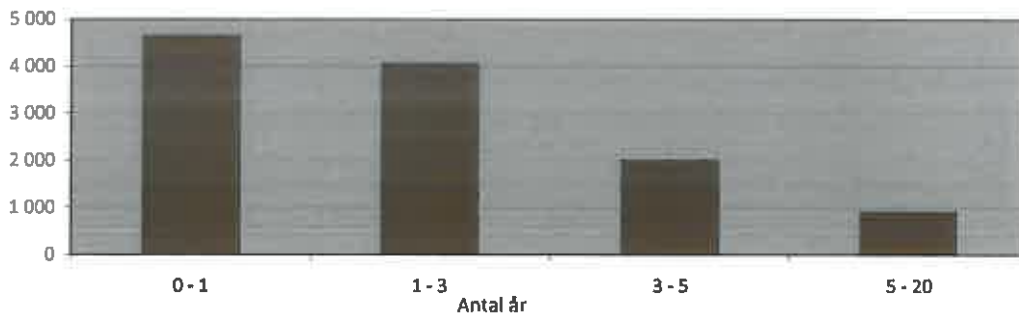
RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Ränte-bindning	Mkr	%-andel av total skuld	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
0 - 1	4 637	40%	45%	35% - 55%	Ja
1 - 3	4 050	35%	45%	35% - 55%	Ja
3 - 5	2 000	17%	10%	0% - 20%	Ja
5 - 20	896	8%	0%	0 - 15%	Ja
Totalt	11 582	100%	100%		

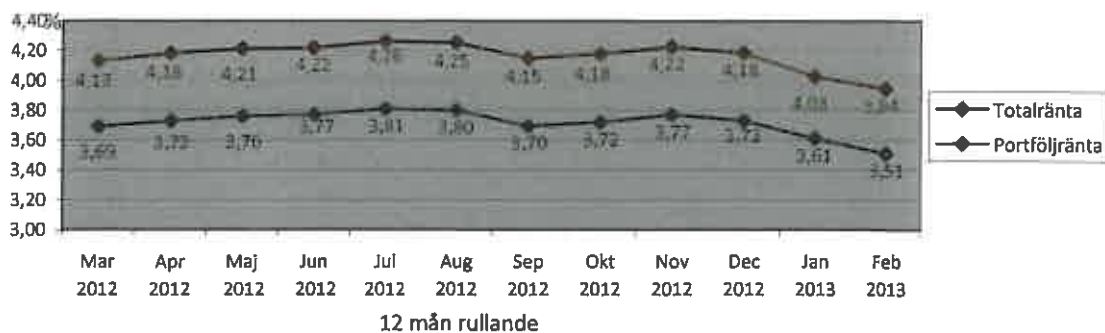
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telge	2013-02-28	Ack. 2013	Prognos 2013
Portföljränta	31,7	64,1	411,8
Finansiella administrativa kostnader	0,4	0,9	6,4
Borgensavgift	4,3	8,3	42,6
Totalt	36,4	73,3	460,8

Preliminära värden



FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2013-02-28 Ack. 2013	
Borgensintäkter	4,4	8,3
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,2	0,4
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	3,0	6,4
Totalt	7,7	15,1

Kommunens kostnader	2013-02-28 Ack. 2013	
Alternativkostnad för räntefria lån enl. särsk. beslut	-0,2	-0,5

UPPFÖLNING AV LÅNE- OCH BORGENSRAMAR [Mkr]

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Bokföringsdatum
			Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 268,4	1 231,6
varav Syvab	124,6	115,2	9,4
varav Söderenergi AB	1 596,0	682,0	914,0
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	15,7	15,2	0,4
Telgekoncernen hel- och delägda bolag	13 300,0	12 441,7	858,3
varav lån via koncernkonto Nordea		11 092,3	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		738,6	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		45,8	
Total	15 800,0	13 710,1	2 089,9

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	30,4

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	-1 år	-1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	12-02-28	13-01-31	13-02-28	14-03-13
Stibor 3M	2,36	1,18	1,22	1,42
Swap 2 år	1,98	1,35	1,38	1,73
Swap 5 år	2,19	1,87	1,83	2,15
Swap 10 år	2,57	2,39	2,36	2,56

