



KS 2014-04-03

## FINANSIELL RISKRAPPORT 2014-02-28

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2014-04-03

### SAMMANFATTNING

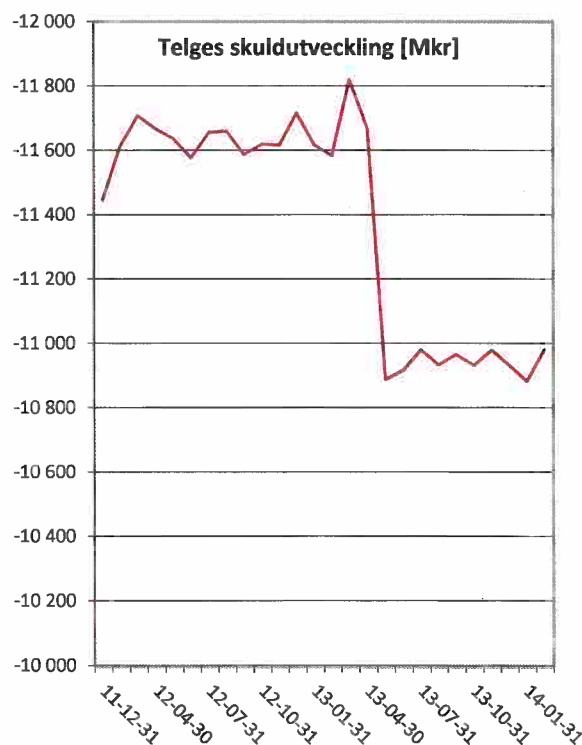
Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid	4 år	3 - 5 år	3,3 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	-	≥ 80%	93%	<input checked="" type="checkbox"/>
Bet.kapacitet/Utestående cert.volym	-	≥ 50%	287%	<input checked="" type="checkbox"/>
Bet.kapacitet/Cert.förfall inom 30 dagar	-	≥ 100%	790%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid/lån	-	≤ 20 år	17 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 0 - 1 år	45%	35% - 55%	43%	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 1 - 3 år	45%	35% - 55%	41%	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 3 - 5 år	10%	0% - 20%	16%	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 5 - 20 år	0%	0% - 15%	0%	<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Motpartsrisk derivat: Såväl rating, beloppsgränser som löptider följer regler enl. Finansiella föreskrifter				<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Borgen: Utlåning och utgiven borgen ligger inom givna ramar enligt Mål & budget				<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Placering av ev. överskottlikviditet: har skett enl. regler i Finansiella föreskrifter				<input checked="" type="checkbox"/>

### INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	Bokföringsdatum			Skulder (finansiering)	Bokföringsdatum		
	14-02-28	14-01-31	13-12-31		14-02-28	14-01-31	13-12-31
Placering Telge	10 980	10 882	10 932	Certifikat, KC-programmet	1 100	1 450	1 400
Reverser Söderenergi	670	674	674	Obligationer, MTN-progr.	3 789	3 788	3 788
Reverser Fotbollsarenan	82	82	82	Övriga obligationer	3 387	3 387	3 387
Reverser SSK Arena	72	72	71	Lån från Kommuninvest	600	600	600
Reverser Täljehallen	28	28	29	Banklån	1 838	1 838	1 838
Reverser andra komm.	0	0	150	Lån från andra kommuner	0	0	0
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Kreditfaciliteter	0	0	0
Tillf. Överskottlikviditet	0	0	0	Återplac. Söderenergi	0	0	0
				Lån från kommunens likv.	1 118	676	924
<b>Summa IBs tillgångar</b>	<b>11 833</b>	<b>11 739</b>	<b>11 938</b>	<b>Summa IBs skulder</b>	<b>11 833</b>	<b>11 739</b>	<b>11 938</b>

### PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	14-02-28	14-01-31	13-12-31
Telge Fastigheter	-3 623	-3 630	-3 638
Telge Bostäder	-2 304	-2 306	-2 313
Telge Hovsjö	-467	-464	-451
Telge Brandalsund	-105	-105	-105
Luna	-508	-506	-508
Maren	-515	-512	-513
Södertälje Hamn	-183	-183	-185
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	101	91	44
Telge Hamn	-154	-154	-154
Telge Inköp	7	5	6
Telge Kraft	-159	-52	-59
Telge Krafthandel	16	18	18
Telge AB	-830	-796	-787
Telge Nät	-1 857	-1 892	-1 896
Telge Tillväxt i S-tälje	0	1	-1
Tom Tits	11	3	4
Telge Återvinning	-35	-29	-23
Telge Miljöteknik	10	10	10
Södertälje Förvaltnings	-386	-385	-384
<b>Total</b>	<b>-10 980</b>	<b>-10 882</b>	<b>-10 932</b>



## PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit?
Svenska staten		0	
Huddinge kommun		0	
Botkyrka kommun		0	
Koncernkontot		58,1	Ja
Övrig motpart*		0	
<b>Totalt</b>		<b>58,1</b>	

\* Övrig motpart kan antingen vara kontoinlåning/placering i skandinavisk bank som innehar en rating som uppfyller minst ett av följande kriterier: 1) A- (S&P) eller A3 (Moody's), 2) Penningmarknadsinstrument som innehar lägst A-1/K-1 rating (S&P)

## KOMMUNKONCERNENS BETALNINGSBEREDSKAP [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	58,1	658,1	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
<b>Totalt</b>	<b>3 100</b>	<b>58,1</b>	<b>3 158,1</b>	

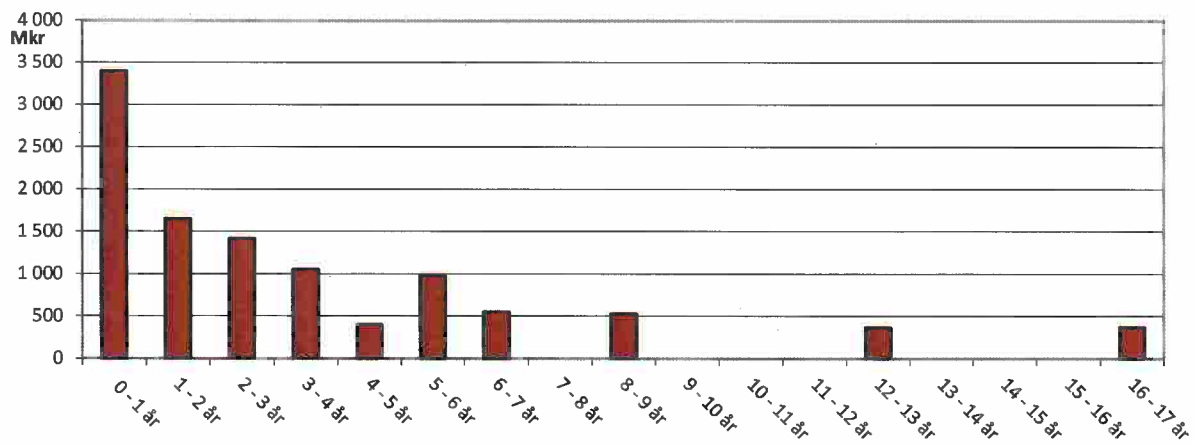
## KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	1 100	2 900
MTN-obligationer	5 000	3 789	1 211
<b>Totalt</b>	<b>9 000</b>	<b>4 889</b>	<b>4 111</b>

## FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten

Kapitalbindning



## MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

Motpart	Telge	SÖEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-109,9	0,0	-109,9	-110,7
Bank 2	-8,4	0,0	-8,4	-10,9
Bank 3	-49,0	-3,9	-53,0	-80,5
Bank 4	-8,3	-9,1	-17,4	-20,6
Bank 5	-56,8	-41,5	-98,3	-97,5
Bank 6	-33,7	0,0	-33,7	-51,0
Bank 7	-16,4	0,0	-16,4	-16,0
Bank 8	-28,1	-139,9	-167,9	-165,9
<b>Totalt</b>	<b>-310,6</b>	<b>-194,4</b>	<b>-505,0</b>	<b>-553,0</b>

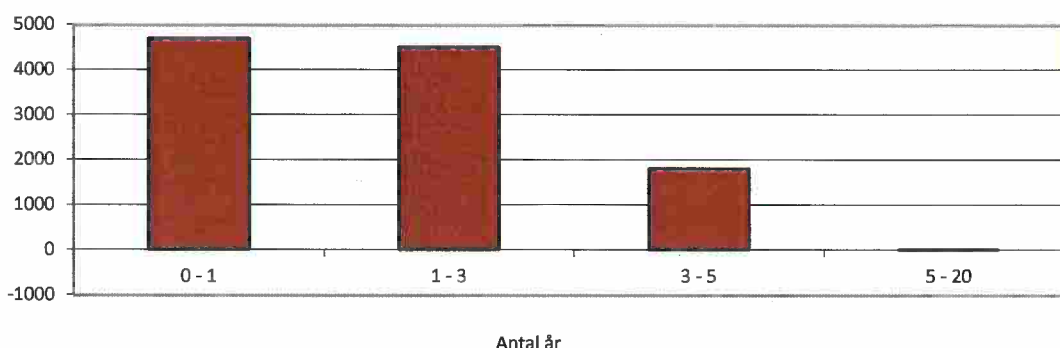
## RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Ränte-bindning	Mkr	%-andel av total skuld	Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
Antal år					
0 - 1	4 684	43%	45%	35% - 55%	Ja
1 - 3	4 500	41%	45%	35% - 55%	Ja
3 - 5	1 800	16%	10%	0% - 20%	Ja
5 - 20	-4	0%	0%	0 - 15%	Ja
<b>Totalt</b>	<b>10 980</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>		

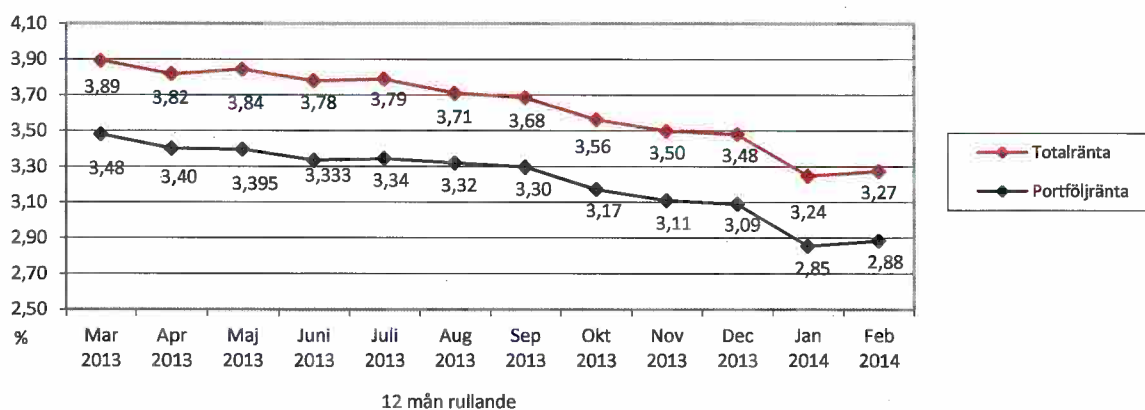
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



## FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2014-02-28	Ack. 2014	Prognos 2014
Portföljränta	22,6	48,9	328,9
Finansiella administrativa kostnader	0,4	0,9	6,8
Borgensavgift	3,5	7,0	42,6
<b>Totalt</b>	<b>26,5</b>	<b>56,8</b>	<b>378,3</b>

Preliminära värden



## FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2014-02-28	Ack. 2014
Borgensintäkter	3,9	7,6
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,3	0,6
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	0,9	1,9
<b>Totalt</b>	<b>5,1</b>	<b>10,1</b>

## UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENSRAMAR [Mkr]

2014-02-28

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
<b>Södertälje kommun</b>	<b>2 500,0</b>	<b>1 640,6</b>	<b>859,4</b>
varav Syvab	124,6	115,2	9,4
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 329,0	267,0
varav Fotbollsarenan AB	82,5	82,5	0,0
varav SSK Arena AB	83,0	72,0	11,0
varav Täljehallen AB	32,6	28,5	4,1
varav övrig kommunal borgen	12,7	11,1	1,6
<b>Telgekoncernen hel- och delägda bolag</b>	<b>13 300,0</b>	<b>11 789,7</b>	<b>1 510,3</b>
varav lån via koncernkonto Nordea		10 490,0	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		687,1	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		46,3	
<b>Total</b>	<b>15 800,0</b>	<b>13 430,3</b>	<b>2 369,7</b>

## LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	26,3

Preliminära värden

## MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	13-02-28	14-01-31	14-02-28	15-02-28
Stibor 3M	1,22	0,95	0,93	1,09
Swap 2 år	1,38	1,21	1,12	1,60
Swap 5 år	1,83	1,96	1,86	2,29
Swap 10 år	2,36	2,61	2,54	2,80

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

