

KS20140425

FINANSIELL RISKRAPPORT 2014-03-31

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2014-04-25

SAMMANFATTNING

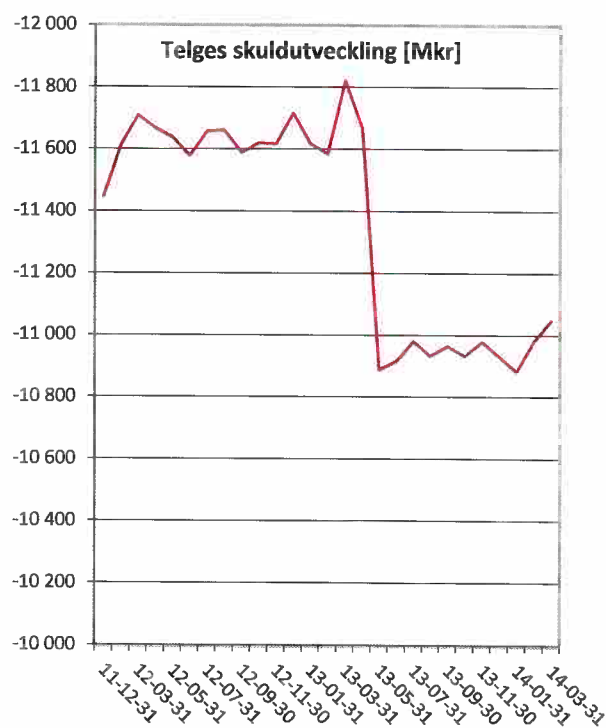
Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid	4 år	3 - 5 år	3,9 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	-	≥ 80%	102%	<input checked="" type="checkbox"/>
Bet.kapacitet/Utestående cert.volym	-	≥ 50%	316%	<input checked="" type="checkbox"/>
Bet.kapacitet/Cert.förfall inom 30 dagar	-	≥ 100%	452%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid/lån	-	≤ 20 år	20 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 0 - 1 år	45%	35% - 55%	48%	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 1 - 3 år	45%	35% - 55%	35%	<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%	1%	<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Motpartsrisk derivat: Såväl rating, beloppsgränser som löptider följer regler enl. Finansiella föreskrifter				<input checked="" type="checkbox"/>
- En motpart har lägre rating än vad som är angivet i finansiella föreskrifter. Inga nya affärer ingås med denna motpart och utvecklingen övervakas noggrant, allt i enlighet med finansiella föreskrifter.				
♦ Borgen: Utlåning och utgiven borgen ligger inom givna ramar enligt Mål & budget				<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Placering av ev. överskottslikviditet: har skett enl. regler i Finansiella föreskrifter				<input checked="" type="checkbox"/>

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	Bokföringsdatum			Skulder (finansiering)	Bokföringsdatum		
	14-03-31	14-02-28	13-12-31		14-03-31	14-02-28	13-12-31
Placering Telge	11 047	10 980	10 932	Certifikat, KC-programmet	1 000	1 100	1 400
Reverser Söderenergi	586	670	674	Obligationer, MTN-progr.	3 979	3 789	3 788
Reverser Fotbollsarenan	82	82	82	Övriga obligationer	3 475	3 387	3 387
Reverser SSK Arena	72	72	71	Lån från Kommuninvest	600	600	600
Reverser Täljehallen	28	28	29	Banklån	1 738	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. Överskottslikviditet	0	0	0	Återplac. Söderenergi	0	0	0
				Lån från kommunens likv.	1 022	1 118	924
Summa IBs tillgångar	11 815	11 833	11 938	Summa IBs skulder	11 815	11 833	11 938

PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	14-03-31	14-02-28	13-12-31
Telge Fastigheter	-3 626	-3 623	-3 638
Telge Bostäder	-2 317	-2 304	-2 313
Telge Hovsjö	-475	-467	-451
Telge Brandalsund	-106	-105	-105
Luna	-503	-508	-508
Maren	-514	-515	-513
Södertälje Hamn	-184	-183	-185
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	33	101	44
Telge Hamn	-154	-154	-154
Telge Inköp	6	7	6
Telge Kraft	-209	-159	-59
Telge Krafthandel	17	16	18
Telge AB	-793	-830	-787
Telge Nät	-1 839	-1 857	-1 896
Telge Tillväxt i S-tälje	0	0	-1
Tom Tits	8	11	4
Telge Återvinning	-8	-35	-23
Telge Miljöteknik	0	10	10
Södertälje Förvaltnings	-387	-386	-384
Total	-11 047	-10 980	-10 932



PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit?
Svenska staten		0	
Huddinge kommun		0	
Botkyrka kommun		0	
Koncernkontot		63,1	Ja
Övrig motpart*		0	
Totalt		63,1	

* 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	63,1	663,1	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Totalt	3 100	63,1	3 163,1	

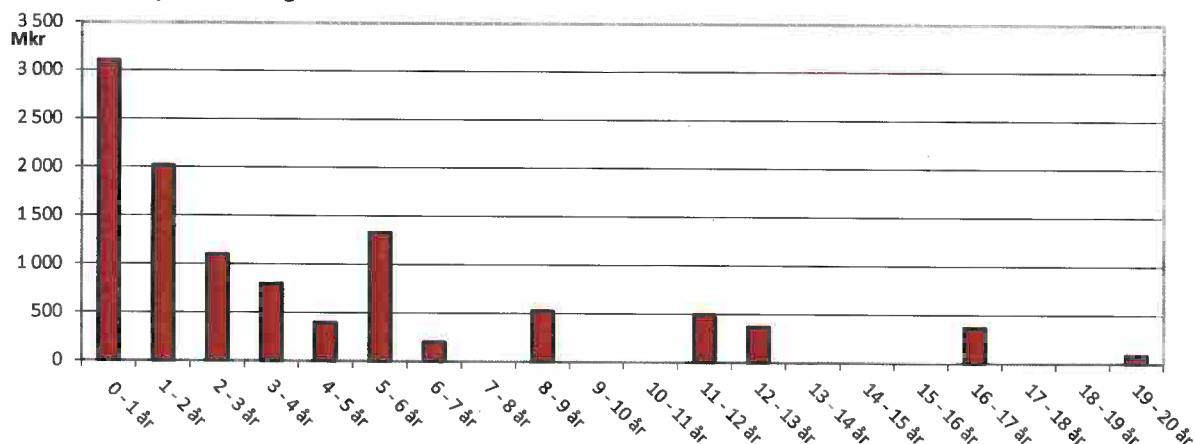
KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	1 000	3 000
MTN-obligationer	5 000	3 979	1 021
Totalt	9 000	4 979	4 021

FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten

Kapitalbindning



MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

Motpart	Telge	SOEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-115,5	0,0	-115,5	-109,9
Bank 2	-5,6	0,0	-5,6	-8,4
Bank 3	-37,8	-4,1	-41,9	-53,0
Bank 4	-2,8	-8,6	-11,4	-17,4
Bank 5	-58,2	-41,5	-99,7	-98,3
Bank 6	-30,1	0,0	-30,1	-33,7
Bank 7	-17,6	0,0	-17,6	-16,4
Bank 8	-21,6	-144,2	-165,8	-167,9
Totalt	-289,1	-198,5	-487,6	-505,0

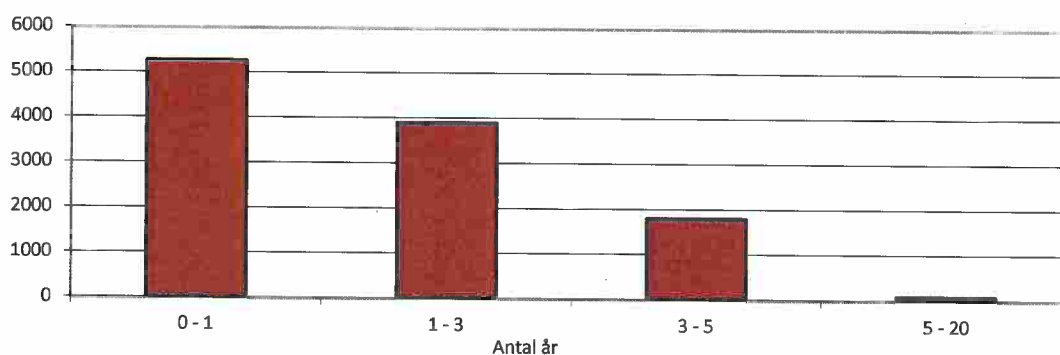
RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Ränte-bindning	%andel		Norm	Tillåtet intervall	Inom tillåtet intervall?
Antal år	Mkr	av total skuld			
0 - 1	5 263	48%	45%	35% - 55%	Ja
1 - 3	3 900	35%	45%	35% - 55%	Ja
3 - 5	1 800	16%	10%	0% - 20%	Ja
5 - 20	84	1%	0%	0 - 15%	Ja
Totalt	11 047	100%	100%		

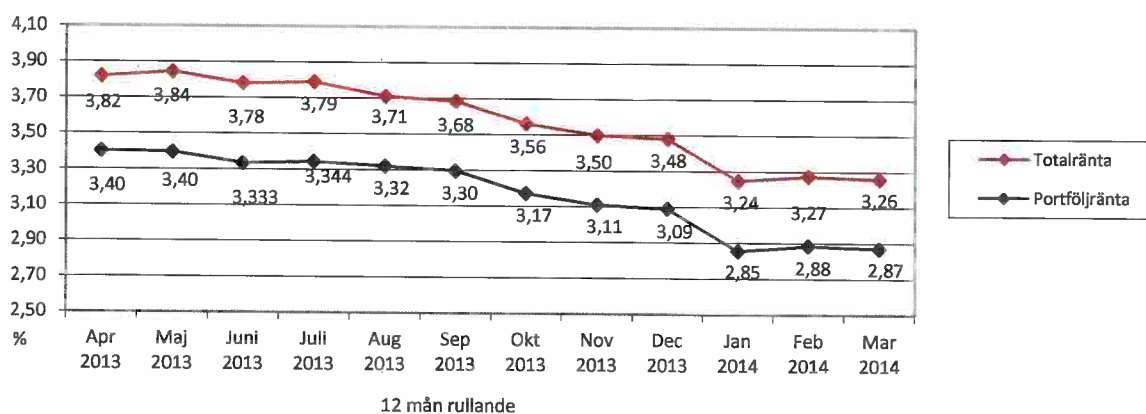
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2014-03-31	Ack. 2014	Prognos 2014
Portföljränta	24,7	73,6	325,7
Finansiella administrativa kostnader	0,5	1,3	6,8
Borgensavgift	3,5	10,5	42,6
Totalt	28,7	85,4	375,1

Preliminära värden



FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2014-03-31	Ack. 2014
Borgensintäkter	3,9	11,7
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,3	0,9
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	1,0	3,0
Totalt	5,2	15,6

UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENS RAMAR [Mkr]

2014-03-31

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 550,3	949,7
varav Syvab	124,6	115,2	9,4
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 239,5	356,5
varav Fotbollsarenan AB	81,8	81,8	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	11,0	1,7
Telgekoncernen hel- och delägda bolag	13 300,0	11 860,3	1 439,7
varav lån via koncernkonto Nordea		10 557,0	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		690,6	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		46,3	
Total	15 800,0	13 410,6	2 389,4

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	25,6

Preliminära värden

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	13-03-28	14-02-28	14-03-31	15-03-31
Stibor 3M	1,24	0,93	0,92	1,05
Swap 2 år	1,42	1,12	1,07	1,57
Swap 5 år	1,79	1,86	1,80	2,26
Swap 10 år	2,29	2,54	2,47	2,76

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

