

FINANSIELL RISKRAPPORT 2014-05-31

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2014-06-13

SAMMANFATTNING

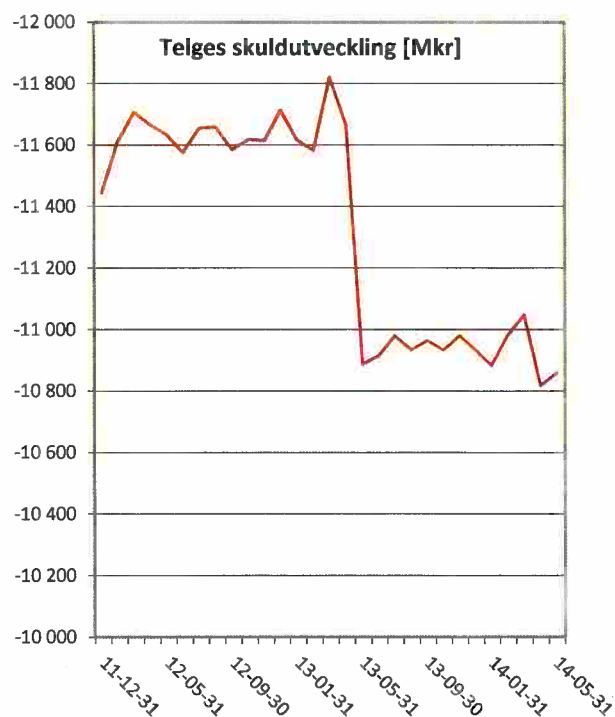
Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid	4 år	3 - 5 år	4,0 år	✓
LCR	-	≥ 80%	102%	✓
Bet.kapacitet/Utestående cert.volym	-	≥ 50%	353%	✓
Bet.kapacitet/Cert.förfall inom 30 dagar	-	≥ 100%	3173%	✓
Längsta kap.bindningstid/lån	-	≤ 20 år	20 år	✓
Räntebindning	-	1,5 - 2,5 år	2,3 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	-	≤ 55%	37%	✓
♦ Motpartsrisk derivat: Såväl rating, beloppsgränser som löptider följer regler enl. Finansiella föreskrifter				
- 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				
♦ Placering av ev. överskottslikviditet: har skett enl. regler i Finansiella föreskrifter				

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	Bokföringsdatum			Skulder (finansiering)	Bokföringsdatum		
	14-05-31	14-04-30	13-12-31		14-05-31	14-04-30	13-12-31
Placering Telge	10 858	10 816	10 932	Certifikat, KC-programmet	900	700	1 400
Reverser Söderenergi	548	569	674	Obligationer, MTN-progr.	3 783	3 783	3 788
Reverser Fotbollsarenan	82	82	82	Övriga obligationer	3 475	3 475	3 387
Reverser SSK Arena	72	72	71	Lån från Kommuninvest	600	600	600
Reverser Täljehallen	28	28	29	Banklån	1 738	1 738	1 838
Reverser andra komm.	0	0	150	Lån från andra kommuner	0	250	0
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 165	1 137	1 086
Saldo koncernkonto	73	116	162				
Summa IBs tillgångar	11 661	11 684	12 099	Summa IBs skulder	11 661	11 684	12 099

PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	14-05-31	14-04-30	13-12-31
Telge Fastigheter	-3 604	-3 598	-3 638
Telge Bostäder	-2 331	-2 321	-2 313
Telge Hovsjö	-484	-481	-451
Telge Brandalsund	-106	-106	-105
Luna	-506	-502	-508
Maren	-521	-516	-513
Södertälje Hamn	-182	-180	-185
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	66	78	44
Telge Hamn	-155	-154	-154
Telge Inköp	8	8	6
Telge Kraft	-85	-58	-59
Telge Krafthandel	17	17	18
Telge AB	-817	-816	-787
Telge Nät	-1 801	-1 831	-1 896
Telge Tillväxt i S-tälje	-1	0	-1
Tom Tits	31	35	4
Telge Återvinning	-1	-4	-23
Telge Miljöteknik	0	0	10
Södertälje Förvaltnings	-389	-388	-384
Total	-10 858	-10 816	-10 932



PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit?
Svenska staten		0	
Huddinge kommun		0	
Botkyrka kommun		0	
Koncernkontot		72,9	Ja
Övrig motpart*		0	
Totalt		72,9	

* 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	72,9	672,9	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Totalt	3 100	72,9	3 172,9	

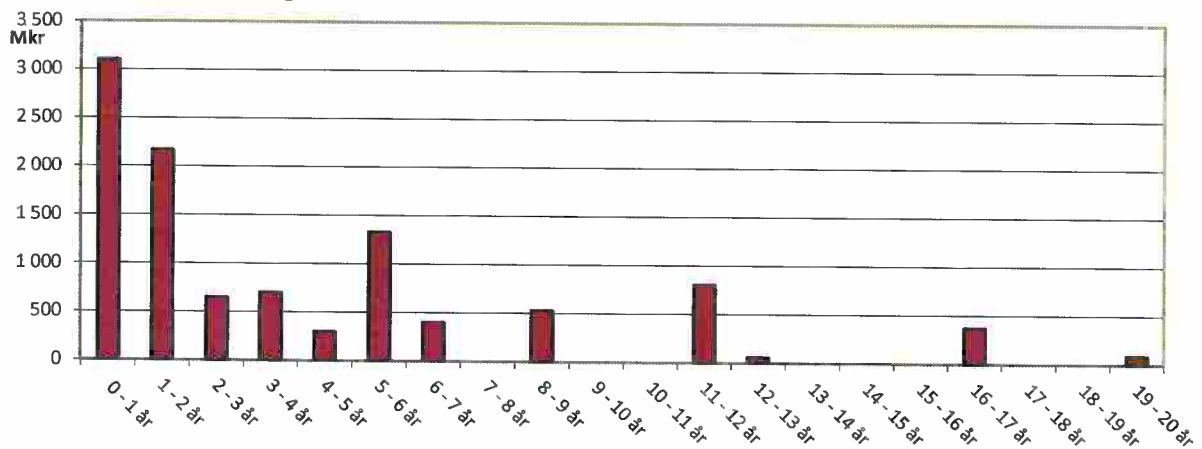
KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	900	3 100
MTN-obligationer	5 000	3 783	1 217
Totalt	9 000	4 683	4 317

FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten

Kapitalbindning



MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

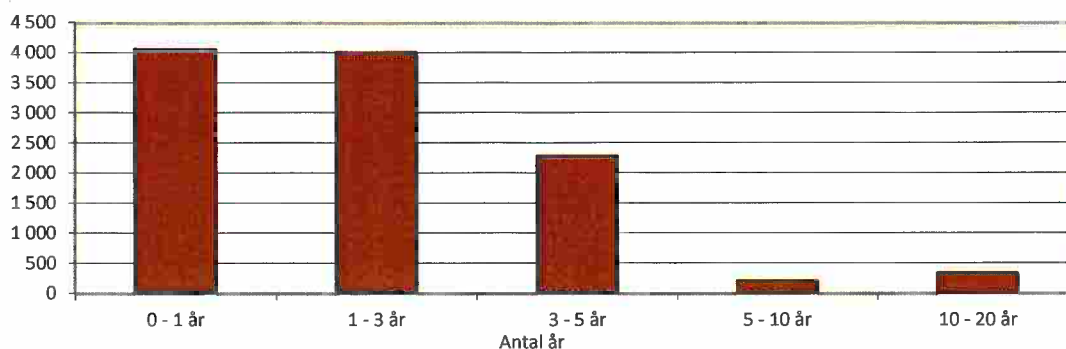
Motpart	Telge	SÖEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-126,9	0,0	-126,9	-109,9
Bank 2	-6,4	0,0	-6,4	-8,4
Bank 3	11,4	-4,6	6,8	-53,0
Bank 4	7,5	-8,0	-0,5	-17,4
Bank 5	-65,8	-42,6	-108,5	-98,3
Bank 6	-13,0	0,0	-13,0	-33,7
Bank 7	-12,4	0,0	-12,4	-16,4
Bank 8	-24,7	-161,8	-186,5	-167,9
Totalt	-230,4	-217,1	-447,5	-505,0

RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

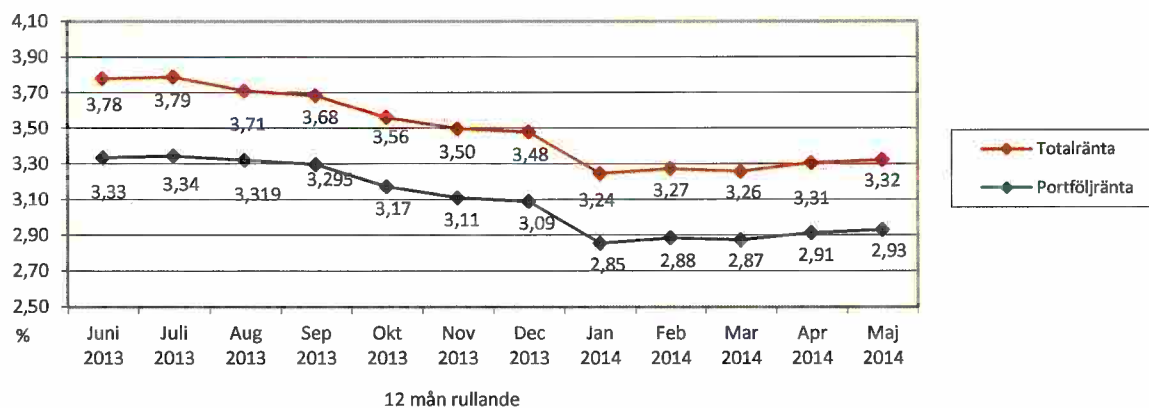
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2014-05-31	Ack. 2014	Prognos 2014
Portföljränta	24,2	122,5	299,7
Finansiella administrativa kostnader	0,6	2,5	6,8
Borgensavgift	3,5	17,7	42,6
Totalt	28,3	142,7	349,1

Preliminära värden



FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2014-05-31	Ack. 2014
Borgensintäkter	3,9	19,6
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,3	1,5
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	0,9	4,9
Totalt	5,1	26,0

UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENS RAMAR [Mkr]

2014-05-31

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 512,5	987,5
varav Syvab	124,6	115,2	9,4
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 201,7	394,3
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	11 942,9	1 357,1
varav lån via koncernkonto Nordea		10 368,3	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		961,9	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		46,3	
Total	15 800,0	13 455,4	2 344,6

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	25,6

Preliminära värden

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	13-05-31	14-04-30	14-05-31	15-05-31
Stibor 3M	1,20	0,91	0,90	0,82
Swap 2 år	1,31	0,94	0,88	1,21
Swap 5 år	1,77	1,61	1,47	1,83
Swap 10 år	2,33	2,31	2,17	2,41

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

