

FINANSIELL RISKRAPPORT 2014-09-30

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2014-10-31

SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid	4 år	3 - 5 år	3,8 år	☑
LCR	-	≥ 80%	102%	☑
Bet.kapacitet/Utestående cert.volym	-	≥ 50%	373%	☑
Bet.kapacitet/Cert.förfall inom 30 dagar	-	≥ 100%	Inga förfall	☑
Längsta kap.bindningstid/lån	-	≤ 20 år	20 år	☑
Räntebindningstid	-	1,5 - 2,5 år	3,1 år	X*
Ränteförfall inom 12 månader	-	≤ 55%	51%	☑
♦ 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				☑

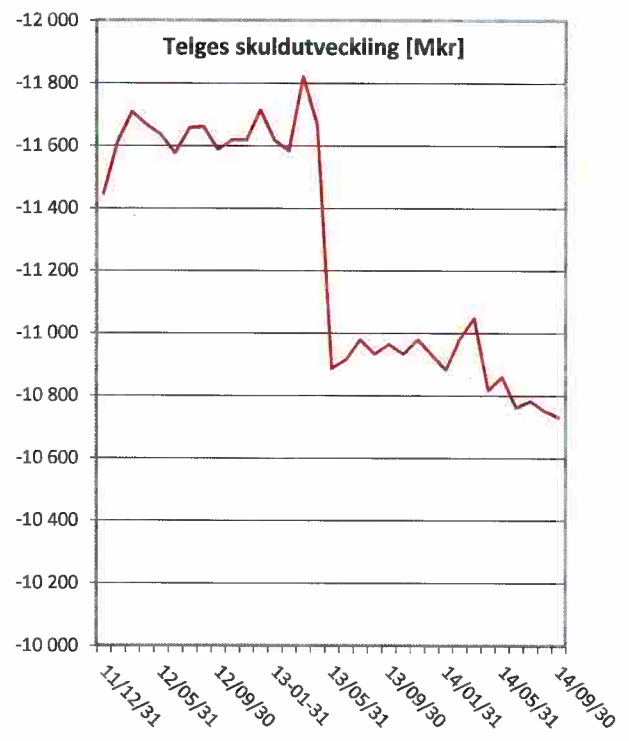
* Stadsdirektören har 2014-08-15 i enlighet med Finansiella föreskrifter p 3.2 beslutat om tillfälligt avsteg avseende räntebindningstiden.

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	Bokföringsdatum			Skulder (finansiering)	Bokföringsdatum		
	14-09-30	14-08-31	13-12-31		14-09-30	14-08-31	13-12-31
Placering Telge	10 730	10 751	10 932	Certifikat, KC-programmet	900	1 200	1 400
Reverser Söderenergi	594	581	674	Obligationer, MTN-progr.	4 186	3 789	3 788
Reverser Fotbollsarenan	80	81	82	Övriga obligationer	3 175	3 175	3 387
Reverser SSK Arena	72	72	71	Lån från Kommuninvest	600	600	600
Reverser Täljehallen	32	32	29	Banklån	1 537	1 537	1 838
Reverser andra komm.	0	75	150	Lån från andra kommuner	0	0	0
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 364	1 329	1 086
Saldo koncernkonto	253	38	162				
Summa IBs tillgångar	11 762	11 631	12 099	Summa IBs skulder	11 762	11 631	12 099

PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	14-09-30	14-08-31	13-12-31
Telge Fastigheter	-3 517	-3 501	-3 638
Telge Bostäder	-2 158	-2 166	-2 313
Telge Hovsjö	-479	-476	-451
Telge Brandalsund	-102	-103	-105
Luna	-501	-508	-508
Maren	-522	-525	-513
Södertälje Hamn	-168	-167	-185
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	56	48	44
Telge Hamn	-152	-152	-154
Telge Inköp	6	5	6
Telge Kraft	-76	-62	-59
Telge Krafthandel	9	11	18
Telge AB	-877	-871	-787
Telge Nät	-1 868	-1 876	-1 396
Telge Tillväxt i S-tälje	0	-1	-1
Tom Tits	3	5	4
Telge Återvinning	-6	-35	-23
Telge Miljöteknik	0	0	10
Södertälje Förvaltnings	-378	-378	-384
Total	-10 730	-10 751	-10 932



PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit?
Svenska staten		0	
Huddinge kommun		0	
Botkyrka kommun		0	
Koncernkontot		253,5	Ja
Övrig motpart*		0	
Totalt		253,5	

* 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]

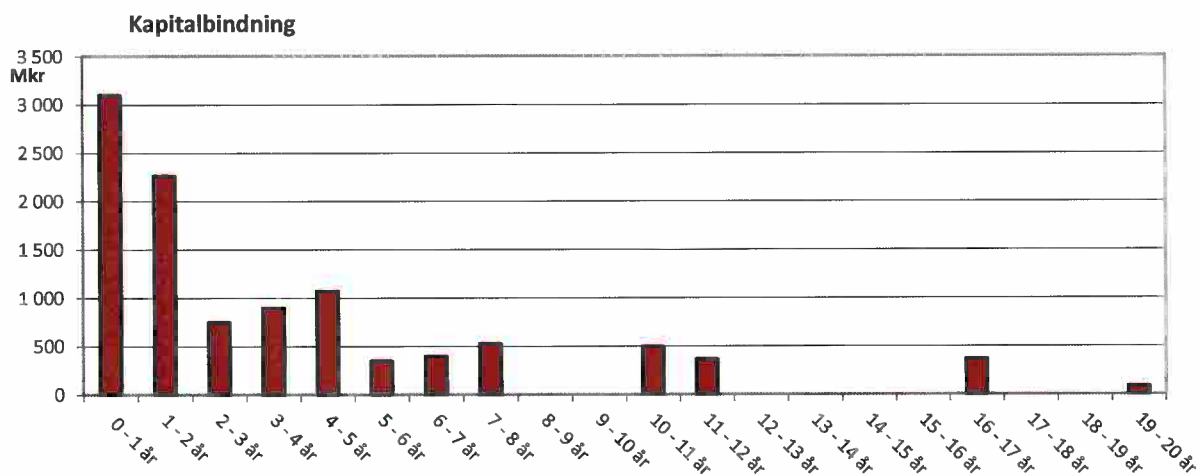
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	253,5	853,5	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Totalt	3 100	253,5	3 353,5	

KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	900	3 100
MTN-obligationer	5 000	4 186	814
Totalt	9 000	5 086	3 914

FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten



MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

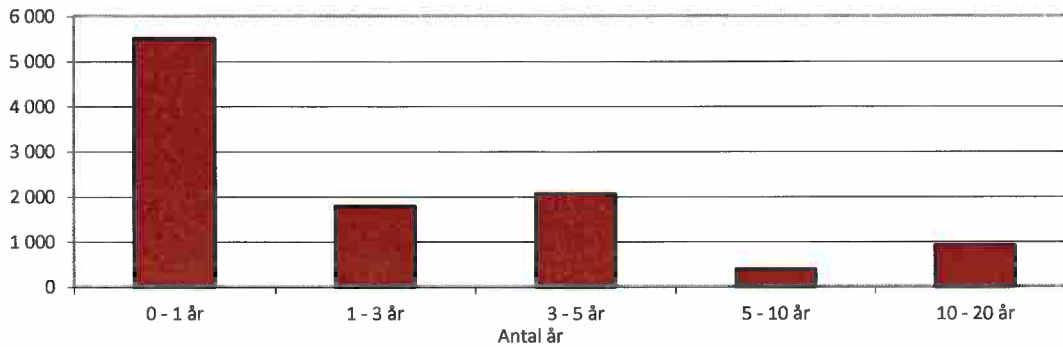
Motpart	Telge	SOEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-158,2	0,0	-158,2	-170,3
Bank 2	-9,2	0,0	-9,2	-9,6
Bank 3	49,1	-5,1	44,0	51,4
Bank 4	20,1	-9,4	10,7	7,6
Bank 5	-62,9	-44,2	-107,1	-114,7
Bank 6	-7,6	0,0	-7,6	-5,9
Bank 7	-7,8	0,0	-7,8	-6,8
Bank 8	-33,5	-182,8	-216,3	-228,8
Totalt	-210,0	-241,5	-451,5	-477,0

RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

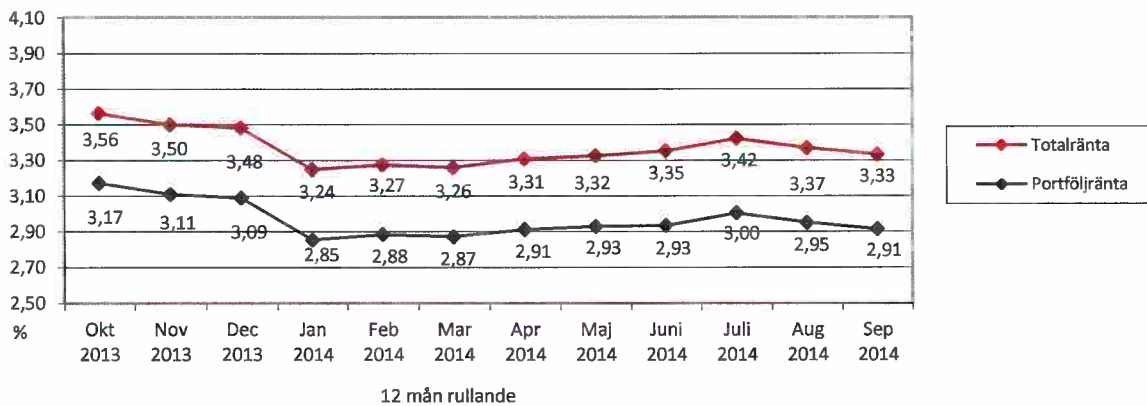
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2014-09-30	Ack. 2014	Prognos 2014
Portföljränta	22,6	216,0	291,8
Finansiella administrativa kostnader	0,6	4,9	6,8
Borgensavgift	3,5	31,9	42,6
Totalt	26,7	252,8	341,2

Preliminära värden



FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2014-09-30	Ack. 2014
Borgensintäkter	3,8	35,0
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,3	2,6
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	0,9	8,5
Totalt	5,0	46,1

UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENSRAMAR [Mkr]

2014-09-30

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 549,9	950,1
varav Syvab	147,2	115,2	32,0
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 238,1	357,9
varav Fotbollsarenan AB	81,0	80,3	0,7
varav SSK Arena AB	83,0	72,0	11,0
varav Täljehallen AB	32,6	32,4	0,2
varav övrig kommunal borgen	12,7	9,5	3,2
Telgekoncernen hel- och delägda bolag	13 300,0	11 641,1	1 658,9
varav lån via koncernkonto Nordea		10 239,7	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		789,0	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		46,3	
Total	15 800,0	13 190,9	2 609,1

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	23,5

Preliminära värden

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	13-09-30	14-08-31	14-09-30	15-09-30
Stibor 3M	1,21	0,50	0,47	0,51
Swap 2 år	1,56	0,55	0,55	0,81
Swap 5 år	2,25	1,02	1,08	1,35
Swap 10 år	2,79	1,65	1,76	1,94

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

