

FINANSIELL RISKRAPPORT 2014-10-31

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2014-11-24

SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid	4 år	3 - 5 år	3,9 år	✓
LCR	-	≥ 80%	117%	✓
Bet.kapacitet/Utestående cert.volym	-	≥ 50%	394%	✓
Bet.kapacitet/Cert.förfall inom 30 dagar	-	≥ 100%	394%	✓
Längsta kap.bindningstid/lån	-	≤ 20 år	19 år	✓
Räntebindningstid	-	1,5 - 2,5 år	2,9 år	X*
Ränteförfall inom 12 månader	-	≤ 55%	52%	✓
♦ 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				✓

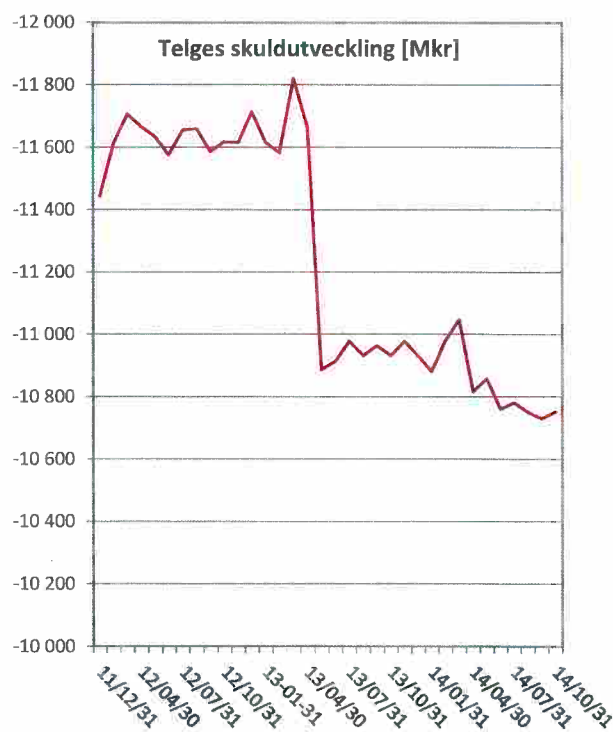
* Stadsdirektören har 2014-08-15 i enlighet med Finansiella föreskrifter p 3.2 beslutat om tillfälligt avsteg avseende räntebindningstiden.

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

				Bokföringsdatum			
Tillgångar (utlåning)	14-10-31	14-09-30	13-12-31	Skulder (finansiering)	14-10-31	14-09-30	13-12-31
Placering Telge	10 753	10 730	10 932	Certifikat, KC-programmet	900	900	1 400
Reverser Söderenergi	607	594	674	Obligationer, MTN-progr.	4 437	4 186	3 788
Reverser Fotbollsarenan	80	80	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	0	150	Lån från andra kommuner	0	0	0
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 338	1 364	1 086
Saldo koncernkonto	442	253	162				
Summa IBs tillgångar	11 987	11 762	12 099	Summa IBs skulder	11 987	11 762	12 099

PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	14-10-31	14-09-30	13-12-31
Telge Fastigheter	-3 500	-3 517	-3 638
Telge Bostäder	-2 153	-2 158	-2 313
Telge Hovsjö	-482	-479	-451
Telge Brandalsund	-102	-102	-105
Luna	-501	-501	-508
Maren	-522	-522	-515
Södertälje Hamn	-164	-168	-185
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	52	56	44
Telge Hamn	-152	-152	-154
Telge Inköp	7	6	6
Telge Kraft	-95	-76	-59
Telge Krafthandel	4	9	18
Telge AB	-880	877	-787
Telge Nät	-1 890	-1 868	-1 296
Telge Tillväxt i S-tälje	-1	0	-1
Tom Tits	9	3	4
Telge Återvinning	-4	-6	-23
Telge Miljöteknik	0	0	10
Södertälje Förvaltnings	-379	-378	-384
Total	-10 753	-10 730	-10 932



1 av 4

Rapportansvarig: Emanuel Dahlqvist

PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit?
Svenska staten		0	
Huddinge kommun		0	
Botkyrka kommun		0	
Koncernkontot		442,0	Ja
Övrig motpart*		0	
Totalt		442,0	

* 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]

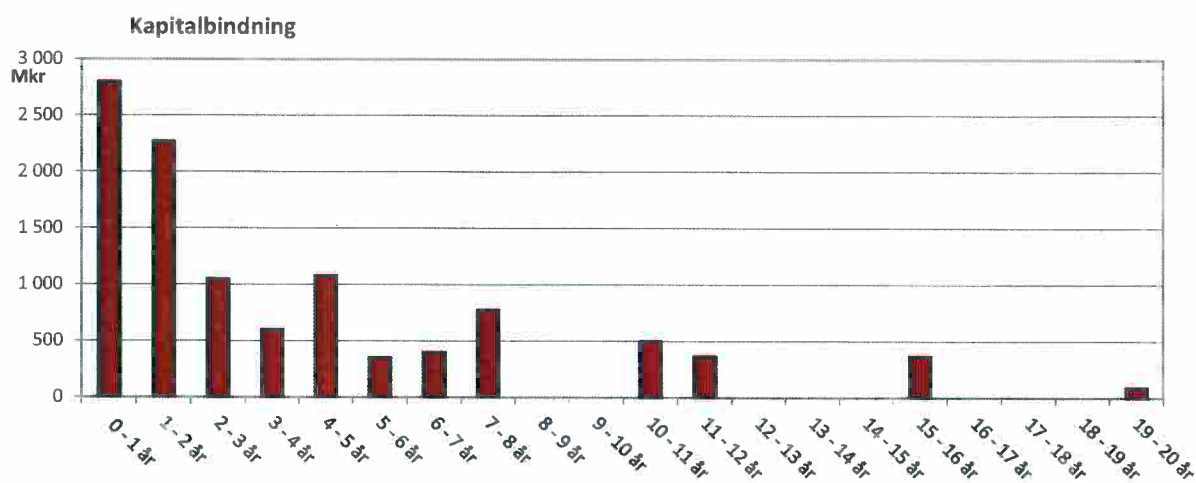
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	442,0	1 042,0	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Totalt	3 100	442,0	3 542,0	

KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	900	3 100
MTN-obligationer	5 000	4 437	563
Totalt	9 000	5 337	3 663

FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten



MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

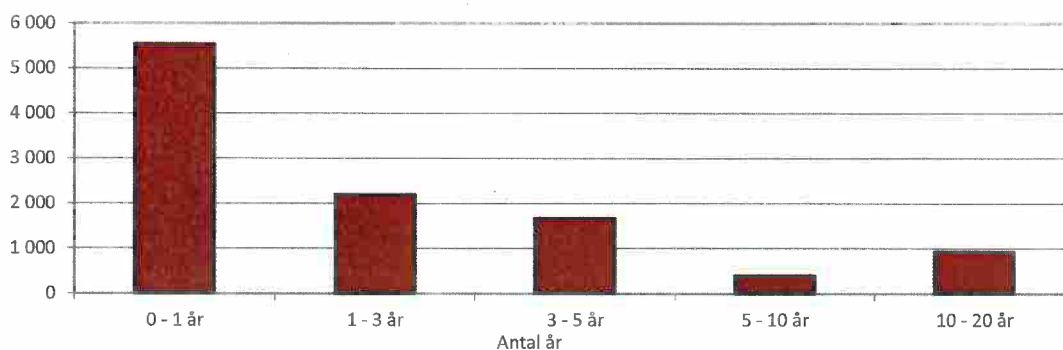
Motpart	Telge	SÖEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-185,4	0,0	-185,4	-158,2
Bank 2	-16,1	0,0	-16,1	-9,2
Bank 3	37,1	-5,5	31,6	44,0
Bank 4	15,1	-12,2	2,9	10,7
Bank 5	-61,2	-46,2	-107,4	-107,1
Bank 6	-21,9	0,0	-21,9	-7,6
Bank 7	-8,1	0,0	-8,1	-7,8
Bank 8	-41,0	-198,7	-239,7	-216,3
Totalt	-281,5	-262,5	-544,0	-451,5

RÄNTERISK

Telge

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

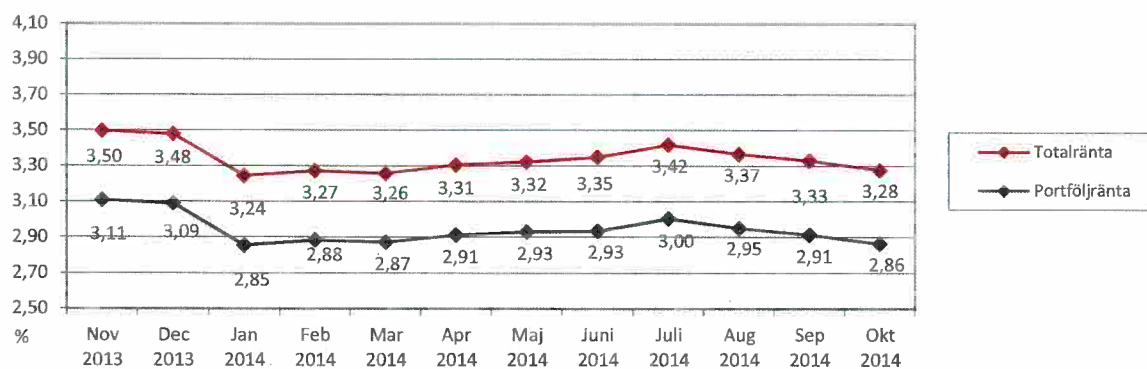
Mkr Ränterisk förfalloprofil Telge



FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2014-10-31	Ack. 2014	Prognos 2014
Portföljränta	23,0	239,0	289,2
Finansiella administrativa kostnader	0,8	5,7	6,8
Borgensavgift	3,5	35,5	42,6
Totalt	27,3	280,2	338,6

Preliminära värden



12 mån rullande

FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2014-10-31	Ack. 2014
Borgensintäkter	4,3	39,3
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,3	2,9
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	1,0	9,6
Totalt	5,6	51,8

UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENSRAMAR [Mkr]

2014-10-31

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
Södertälje kommun	2 500,0	1 562,5	937,5
varav Syvab	147,2	115,2	32,0
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 250,7	345,3
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	11 668,3	1 631,7
varav lån via koncernkonto Nordea		10 263,2	
varav lån via Internbanken		490,0	
varav borgen Telge Kraft		792,8	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		46,3	
Total	15 800,0	13 230,8	2 569,2

LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	23,5

Preliminära värden

MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	13-10-31	14-09-30	14-10-31	15-10-31
Stibor 3M	1,21	0,47	0,25	0,31
Swap 2 år	1,45	0,55	0,31	0,53
Swap 5 år	2,09	1,08	0,74	1,07
Swap 10 år	2,65	1,76	1,47	1,72

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

