

## FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-02-28

KS20150327

Till kommunstyrelsens sammanträde den 2015-03-27

### SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Norm	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	4 år	3 - 5 år	3,9 år	☑
LCR	-	≥ 80%	132%	☑
Bet.kapacitet/tot utestående cert.volym	-	≥ 50%	561%	☑
Bet.kapacitet/Cert. Som förfaller inom 30 dagar	-	≥ 100%	inga förfall	☑
Längsta kap.bindningstid på lån	-	≤ 20 år	19 år	☑
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	-	1,5 - 2,5 år	2,3 år	☑
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				☑
♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finansiella föreskrifter				☑
♦ Placering av ev. överskottslikviditet: har skett enl. regler i Finansiella föreskrifter				☑

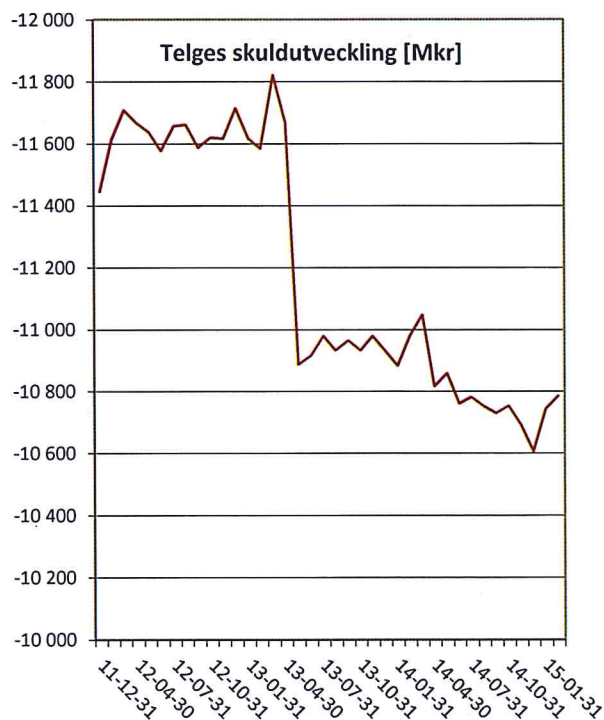
### INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Bokföringsdatum

Tillgångar (utlåning)	15-02-28	15-01-31	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-02-28	15-01-31	14-12-31
Placering Telge	10 785	10 742	10 605	Certifikat, KC-programmet	550	1 100	1 100
Reverser Söderenergi	594	636	636	Obligationer, MTN-progr.	4 519	4 518	4 590
Reverser Fotbollsarenan	0	0	80	Övriga obligationer	3 075	3 075	3 075
Reverser SSK Arena	0	0	72	Lån från Kommuninvest	600	600	600
Reverser Täljehallen	32	32	32	Banklån	1 036	1 036	1 036
Reverser andra komm.	0	70	0	Lån från andra kommuner	242	0	0
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 377	1 282	1 312
Saldo koncernkonto	0	132	289	Nyttjad checkkredit	12	0	0
<b>Summa IBs tillgångar</b>	<b>11 411</b>	<b>11 612</b>	<b>11 714</b>	<b>Summa IBs skulder</b>	<b>11 411</b>	<b>11 612</b>	<b>11 714</b>

### PLACERING TELGE - PER BOLAG [Mkr]

Bolag	15-02-28	15-01-31	14-12-31
Telge Fastigheter	-3 781	-3 789	-3 493
Telge Bostäder	-2 141	-2 139	-2 157
Telge Hovsjö	-465	-463	-491
Telge Brandalsund	-104	-104	-104
Luna	-497	-495	-498
Maren	-405	-405	-525
Södertälje Hamn	-160	-160	-164
Telge Almnäs	1	1	1
Telge Energi	71	87	64
Telge Hamn	-153	-153	-152
Telge Inköp	12	10	8
Telge Kraft	-14	6	24
Telge Krafthandel	4	4	13
Telge AB	-896	-863	-858
Telge Nät	-1 857	-1 887	-1 886
Telge Tillväxt i S-tälje	0	0	-1
Tom Tits	5	6	6
Telge Återvinning	-22	-17	-11
Telge Miljöteknik	0	0	0
Södertälje Förvaltnings	-383	-382	-381
<b>Total</b>	<b>-10 785</b>	<b>-10 742</b>	<b>-10 605</b>



## PLACERING AV ÖVERSKOTTSLIKVIDITET

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

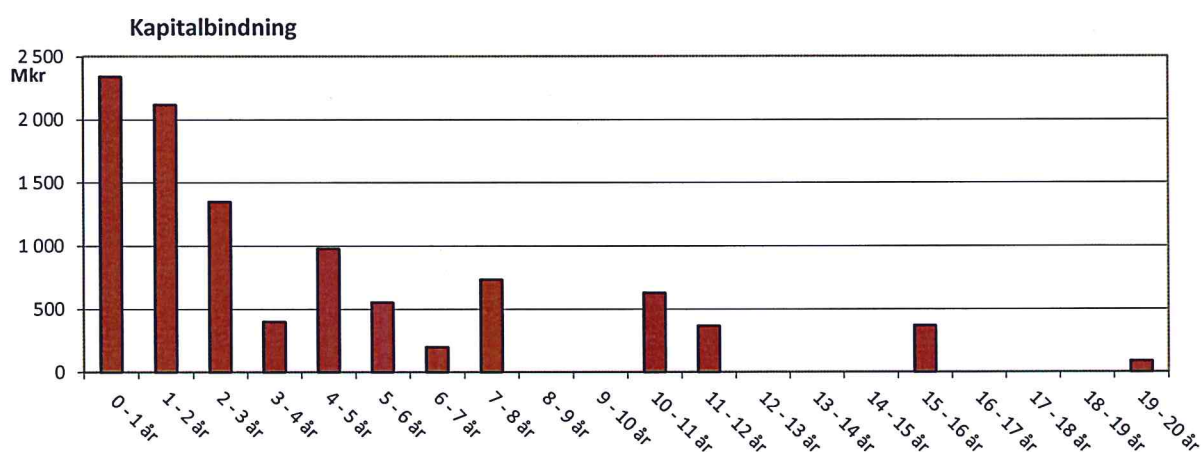
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	-11,9	588,1	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	-
<b>Totalt</b>	<b>3 100</b>	<b>-11,9</b>	<b>3 088,1</b>	

## KAPITALMARKNADSPROGRAM [Mkr]

	Avtalsbelopp	Emitterat	Kvar att utn.
Certifikat	4 000	550	3 450
MTN-obligationer	5 000	4 519	481
<b>Totalt</b>	<b>9 000</b>	<b>5 069</b>	<b>3 931</b>

## FINANSIERINGSRISK

- den samlade verksamheten exkl utlåning av egen likviditet



## MARKNADSVÄRDEN, DERIVAT [Mkr]

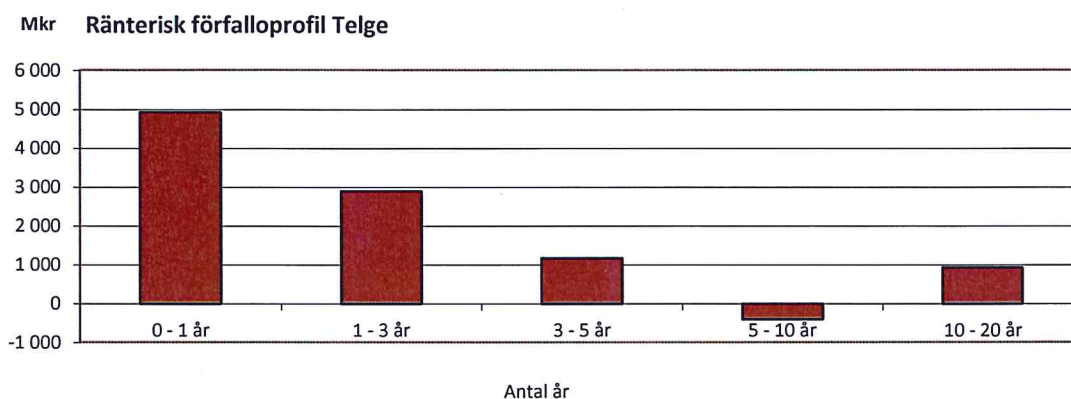
- netto per motpart, negativt värde medför ingen motpartsrisk

Motpart	Telge	SOEN	Totalt MV	MV, föreg. månad
Bank 1	-223,1	0,0	-223,1	-239,6
Bank 2	-12,1	0,0	-12,1	-15,0
Bank 3	61,6	-5,4	56,2	47,5
Bank 4	34,1	-14,8	19,3	5,4
Bank 5	-48,8	-49,3	-98,1	-101,1
Bank 6	-20,8	0,0	-20,8	-33,5
Bank 7	7,5	0,0	7,5	-2,2
Bank 8	-52,5	-214,2	-266,7	-282,1
<b>Totalt</b>	<b>-254,1</b>	<b>-283,7</b>	<b>-537,8</b>	<b>-620,6</b>

## RÄNTERISK

### Telge

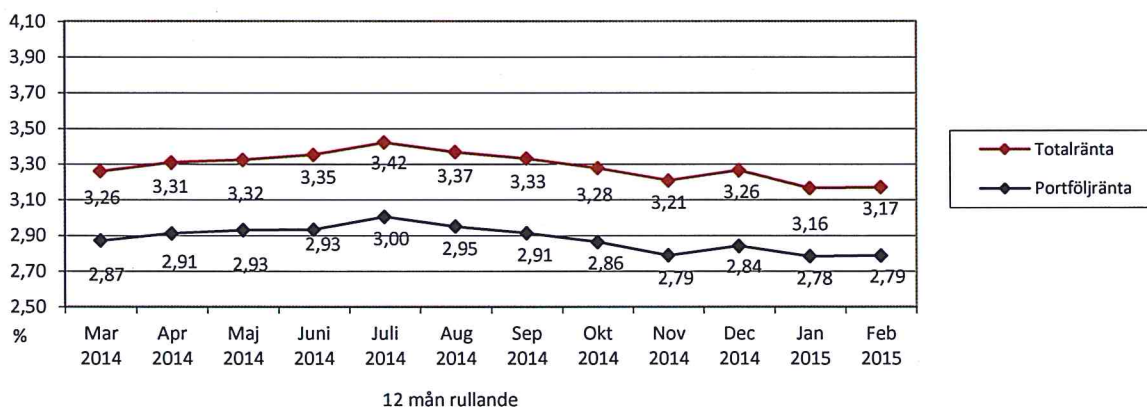
[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]



## FINANSIELLA KOSTNADER [Mkr]

Telges kostnader	2015-02-28	Ack. 2015	Progn 2015
Portföljränta	23,5	48,2	273,0
Borgensavgift	4,1	8,0	42,6
<b>Totalt</b>	<b>27,6</b>	<b>56,2</b>	<b>315,6</b>

Preliminära värden



## FINANSIELLA INTÄKTER [Mkr]

Kommunens intäkter	2015-01-31	Ack. 2015
Borgensintäkter	4,3	8,7
Ränteintäkter på lån enl. särskilda beslut	0,0	0,1
Ränteintäkter för utlånad egen likviditet till Telge och SÖEN	0,3	0,6
<b>Totalt</b>	<b>4,6</b>	<b>9,4</b>

## UPPFÖLJNING AV LÅNE- OCH BORGENS RAMAR [Mkr]

2015-02-28

Kommunkoncernen	Ram	Utnyttjat	Kvar att utnyttja
<b>Södertälje kommun</b>	<b>2 500,0</b>	<b>1 390,1</b>	<b>1 109,9</b>
varav Syvab	147,2	115,2	32,0
varav Söderenergi AB	1 596,0	1 233,0	363,0
varav Täljehallen AB	31,8	31,8	0,0
varav övrig kommunal borgen	11,1	9,2	1,9
<b>Telgekoncernen hel- och delägda bolag</b>	<b>13 000,0</b>	<b>11 753,3</b>	<b>1 246,7</b>
varav lån via koncernkonto Nordea		10 785,3	
varav borgen Telge Kraft		847,2	
varav borgen Telge Återvinning		75,0	
varav pensionsutfästelser		44,8	
<b>Total</b>	<b>15 500,0</b>	<b>13 143,4</b>	<b>2 356,6</b>

## LEASING [Mkr]

Leasingavtal	Beslutat belopp	Utnyttjat belopp
Finansiell billeasing	50	23,5

Preliminära värden

## MARKNADSNOTERINGAR

Marknadsränta	- 1 år	- 1 mån	aktuell	Prognos 1 år
	14-02-28	15-01-31	15-02-28	16-02-28
Stibor 3M	0,93	0,10	0,02	0,12
Swap 2 år	1,12	0,10	0,14	0,39
Swap 5 år	1,86	0,45	0,56	0,88
Swap 10 år	2,54	0,99	1,13	1,38

Källa: Nasdaq/OMX och Nordea e-markets

