

FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-04-30

Till kommunstyrelsens sammanträde 2015-05-22

Rapporten avser allt engagemang i kommunens namn och inkluderar därmed finansiering av Telgekoncernen och Söderenergi AB.

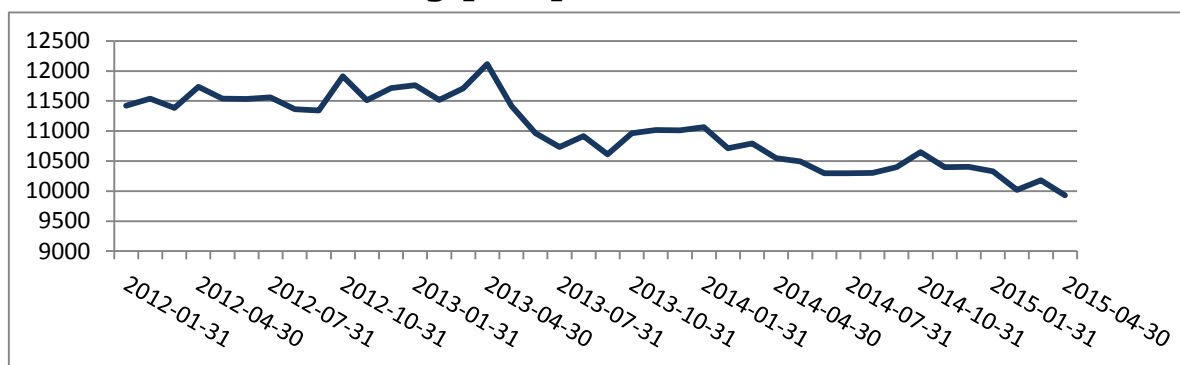
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,9 år	✓
LCR	≥ 80%	105%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	✓
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,6 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	52%	✓
♦ Motpartsrisk derivat: Rating, belopp och krav på avtal följer regler i Finansiella föreskrifter			✓
♦ 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]

Tillgångar (utlåning)	15-04-30	15-03-31	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-04-30	15-03-31	14-12-31
Placering Telge	10 696	10 847	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 621	4 620	4 590
Reverser Söderenergi	531	531	636	Certifikat, KC-programmet	550	550	1 100
Reverser Täljehallen	32	32	32	Övr. extern finansiering	4 761	5 011	4 711
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 302	1 216	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	26	13	0
Saldo koncernkonto	0	0	289				
Summa IBs tillgångar	11 259	11 410	11 714	Summa IBs skulder	11 259	11 410	11 714

Extern skuld utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta extern skuld

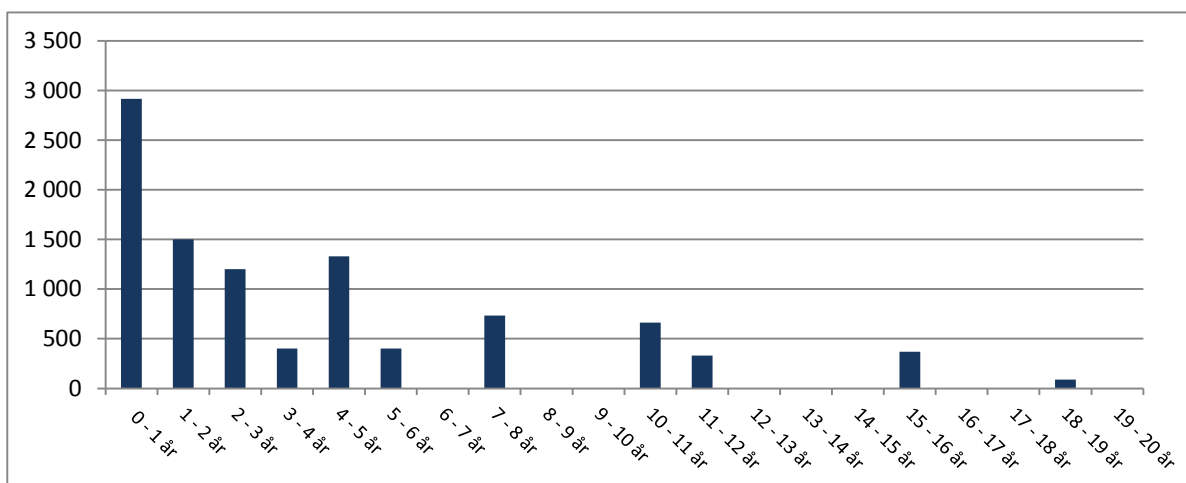
Datum	Genomsnittsränta
2015-01-31	2,90%
2015-02-28	2,89%
2015-03-31	2,85%
2015-04-30	2,74%

FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

[extern skuld totalt 9 931 Mkr]



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

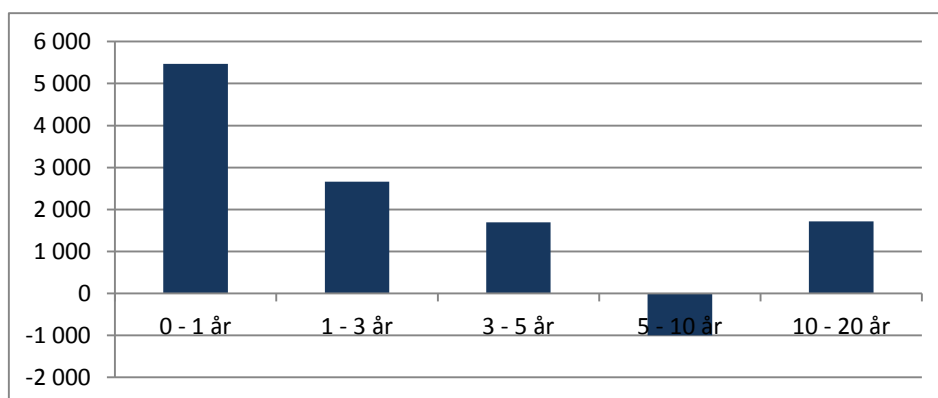
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	-25,7	574,3	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	
Totalt	3 100	-25,7	3 074,3	

RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

[extern skuld plus 42% av Söderenergi AB leasingaffär, totalt 10 534 Mkr]



Det nominella beloppet med förfall i intervallet 5-10 år är negativt. Det beror på att volym derivat där kommunen **erhåller** fast ränta överstiger total volym (lån + derivat) där kommunen **betalar** fast ränta i detta intervall.

Mätningen av finansieringsrisken och ränterisken sker på olika belopp på grund av att leasingaffärerna påverkar ränterisken men inte finansieringsrisken och räntesäkras.

MOTPARTSRISK

Marknadsvärden, derivat [Mkr]

- netto per motpart, negativt värde medför ingen motpartsrisk

Motpart	15-04-30	15-03-31
Bank 1	-235,8	-241,7
Bank 2	-13,7	-14,4
Bank 3	46,6	27,7
Bank 4	11,2	11,8
Bank 5	-92,9	-95,3
Bank 6	-16,1	-35,3
Bank 7	3,2	5,3
Bank 8	-270,8	-279,8
Totalt	-568,4	-621,6

Placering av överskottslikviditet

Motpart	Tot. löptid	Belopp [Mkr]	Inom limit/tillåten rating?
-		0,0	
Totalt		0,0	