



# FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-05-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2015-06-11

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

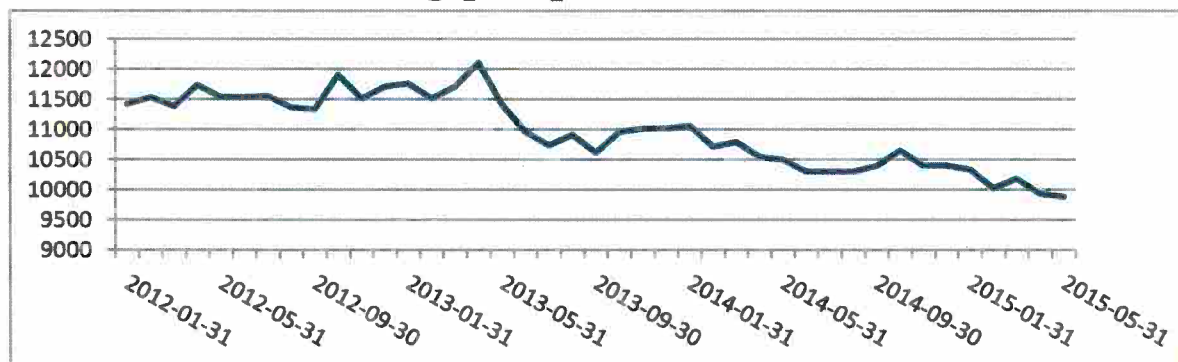
## SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,9 år	✓
LCR	≥ 80%	93%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	✓
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,5 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)	15-05-31	15-04-30	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-05-31	15-04-30	14-12-31
Placering Telge	10 686	10 696	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 421	4 621	4 590
Reverser Söderenergi	506	531	636	Certifikat, KC-programmet	750	550	1 100
Rev övr intressebolag	32	32	183	Övr. extern finansiering	4 711	4 761	4 711
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 340	1 302	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	2	26	0
Saldo koncernkonto	0	0	289				
<b>Summa IBs tillgångar</b>	<b>11 223</b>	<b>11 259</b>	<b>11 714</b>	<b>Summa IBs skulder</b>	<b>11 223</b>	<b>11 259</b>	<b>11 714</b>

## Extern skuld utveckling [Mkr]



## Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
2015-01-31	2,90%
2015-02-28	2,89%
2015-03-31	2,85%
2015-04-30	2,74%
2015-05-31	2,71%

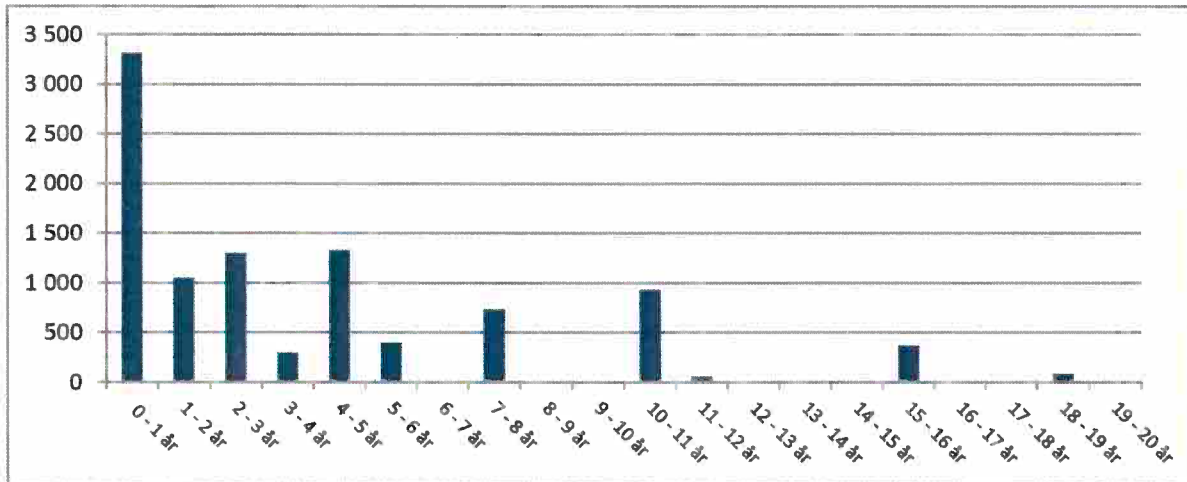
SÖDERTÄLJE KOMMUN Kommunstyrelsen	
2015 -06- 03	
Dnr	Rnr

## FINANSIERINGSRISK

### Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

[extern skuld totalt 9 882 Mkr]



### Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

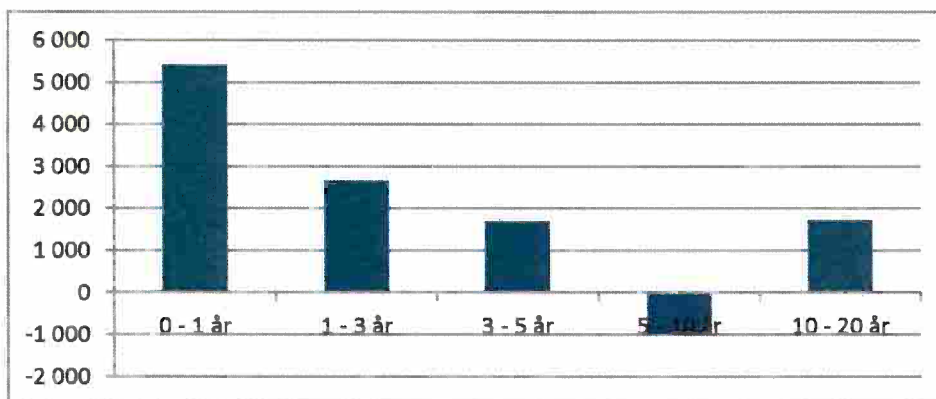
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	-1,7	598,3	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	
<b>Totalt</b>	<b>3 100</b>	<b>-1,7</b>	<b>3 098,3</b>	

## RÄNTERISK

### Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

[extern skuld plus 42% av Söderenergi AB leasingaffär, totalt 10 485 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	15-05-31	15-04-30
Bank 1	-212,1	-235,8
Bank 2	-13,6	-13,7
Bank 3	15,2	46,6
Bank 4	7,6	11,2
Bank 5	-90,1	-92,9
Bank 6	-27,3	-16,1
Bank 7	6,0	3,2
Bank 8	-252,8	-270,8
<b>Totalt</b>	<b>-567,1</b>	<b>-568,4</b>

### Placering av överskottslikviditet

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