



752015 0903

FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-07-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2015-09-03

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

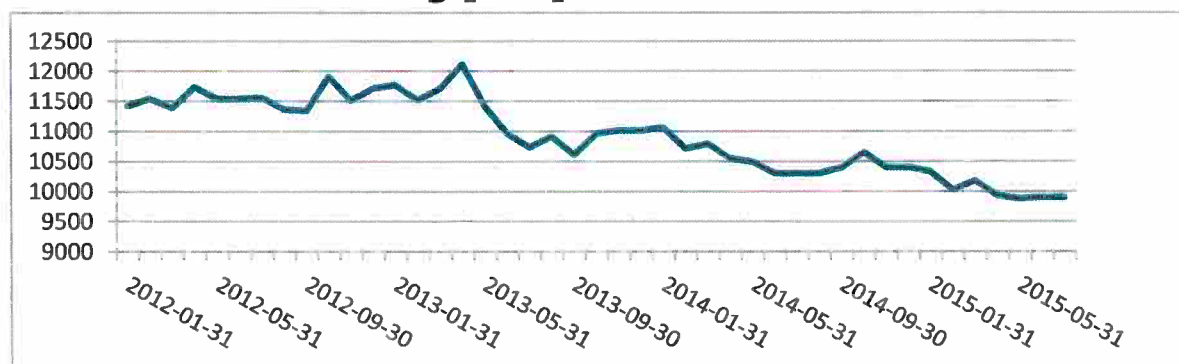
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,7 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	≥ 80%	89%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,2 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	56%	<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Motpartsrisk derivat: Rating, belopp och krav på avtal följer regler i Finansiella föreskrifter			<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finansiella föreskrifter			<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Placering av ev. överskottslikviditet: har skett enl. regler i Finansiella föreskrifter			<input checked="" type="checkbox"/>

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	15-07-31	15-06-30	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-07-31	15-06-30	14-12-31
Placering Telge	10 629	10 622	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 423	4 422	4 590
Reverser Söderenergi	525	506	636	Certifikat, KC-programmet	770	770	1 100
Rev övr intressebolag	32	32	183	Övr. extern finansiering	4 710	4 710	4 711
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 368	1 368	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	85	110	289				
Summa IBs tillgångar	11 271	11 269	11 714	Summa IBs skulder	11 271	11 269	11 714

Extern skuld utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

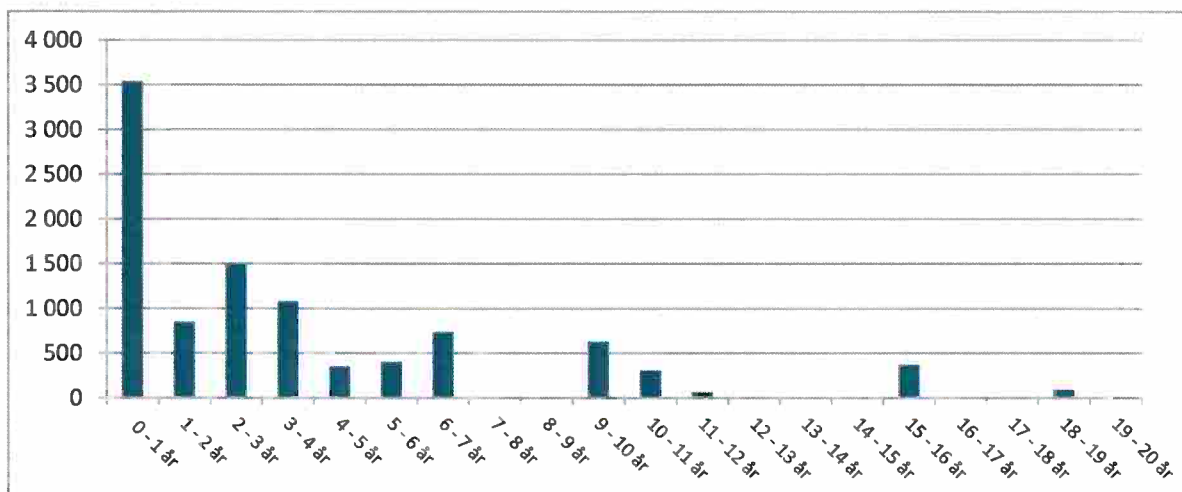
Datum	Genomsnittsränta
2015-01-31	2,90%
2015-02-28	2,89%
2015-03-31	2,85%
2015-04-30	2,74%
2015-05-31	2,71%
2015-06-30	2,67%
2015-07-31	2,49%

FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

[extern skuld totalt 9 903 Mkr]



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

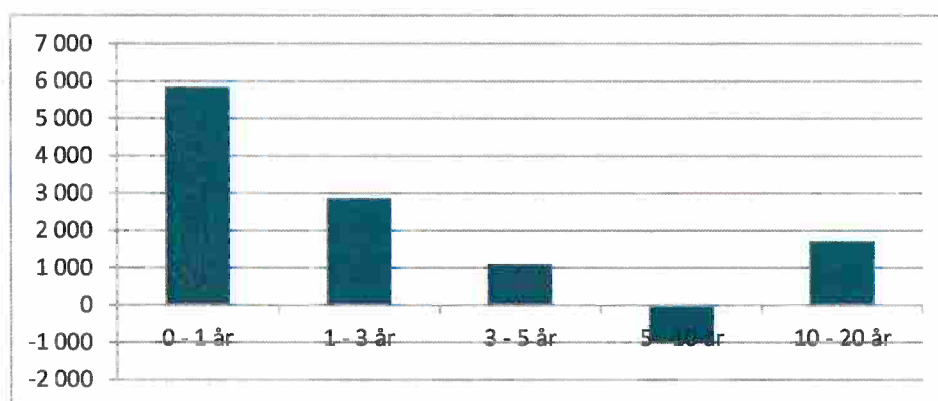
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	85,0	685,0	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	
Totalt	3 100	85,0	3 185,0	

RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

[extern skuld plus 42% av Söderenergi AB leasingaffär, totalt 10 500 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	15-07-31	15-05-31
Bank 1	-199,3	-176,8
Bank 2	-7,8	-10,8
Bank 3	-3,5	-28,7
Bank 4	8,9	-4,2
Bank 5	-83,9	-89,1
Bank 6	-41,6	-43,3
Bank 7	8,0	0,9
Bank 8	-238,5	-224,5
Totalt	-557,7	-576,6

Placering av överskottslikviditet

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