

FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-08-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2015-09-25

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

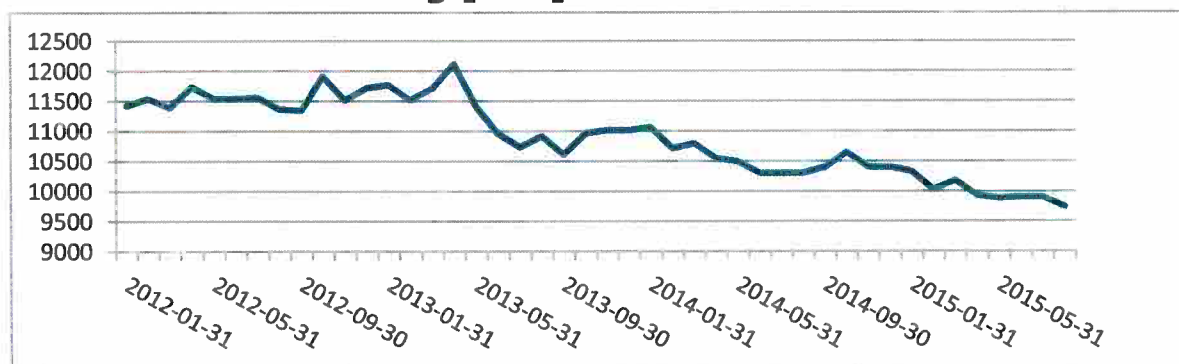
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,7 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	≥ 80%	92%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,3 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	50%	<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)	15-08-31	15-07-31	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-08-31	15-07-31	14-12-31
Placering Telge	10 542	10 629	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 423	4 423	4 590
Reverser Söderenergi	525	525	636	Certifikat, KC-programmet	1 120	770	1 100
Rev övr intressebolag	32	32	183	Övr. extern finansiering	4 200	4 710	4 711
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 390	1 368	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	35	85	289				
Summa IBs tillgångar	11 134	11 271	11 714	Summa IBs skulder	11 134	11 271	11 714

Extern skuld utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

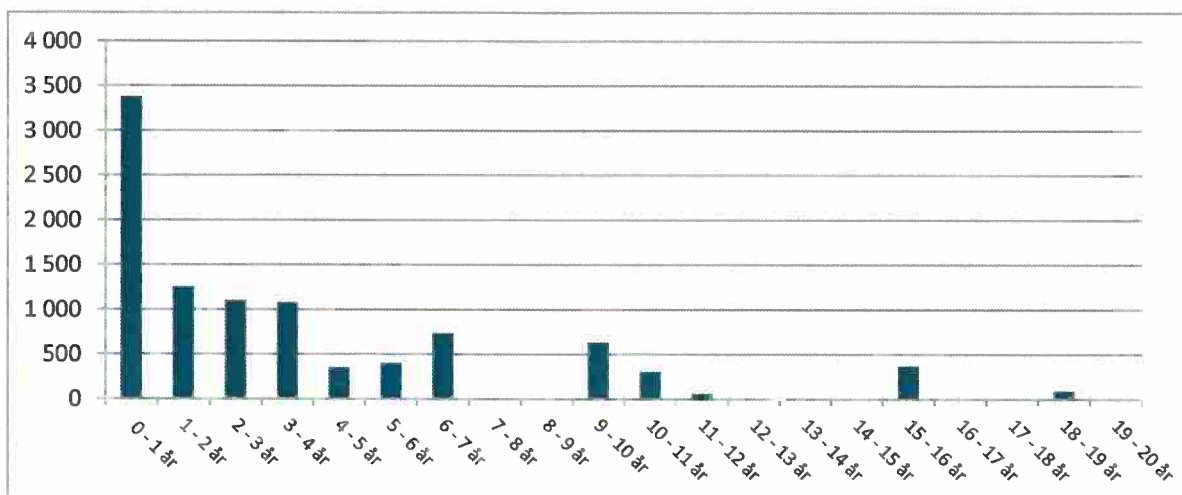
Datum	Genomsnittsränta
2015-01-31	2,90%
2015-02-28	2,89%
2015-03-31	2,85%
2015-04-30	2,74%
2015-05-31	2,71%
2015-06-30	2,67%
2015-07-31	2,49%
2015-08-31	2,31%

FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

[extern skuld totalt 9 744 Mkr]



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

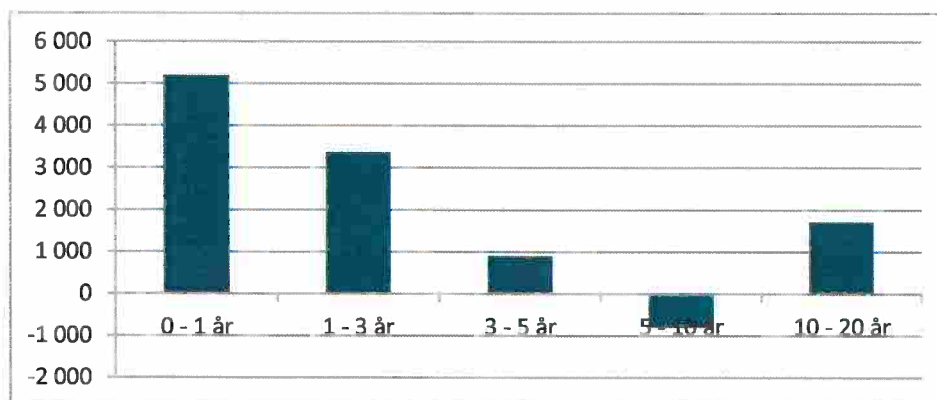
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	35,3	635,3	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	
Totalt	3 100	35,3	3 135,3	

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	15-08-31	15-07-31
Bank 1	-205,4	-199,3
Bank 2	-6,4	-7,8
Bank 3	-29,7	-3,5
Bank 4	10,1	8,9
Bank 5	-81,0	-83,9
Bank 6	-61,9	-41,6
Bank 7	-0,7	8,0
Bank 8	-237,5	-238,5
Totalt	-612,6	-557,7

Placering av överskottslikviditet

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