

FINANSIELL RISKRAPPORT 2015-10-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2015-11-27

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

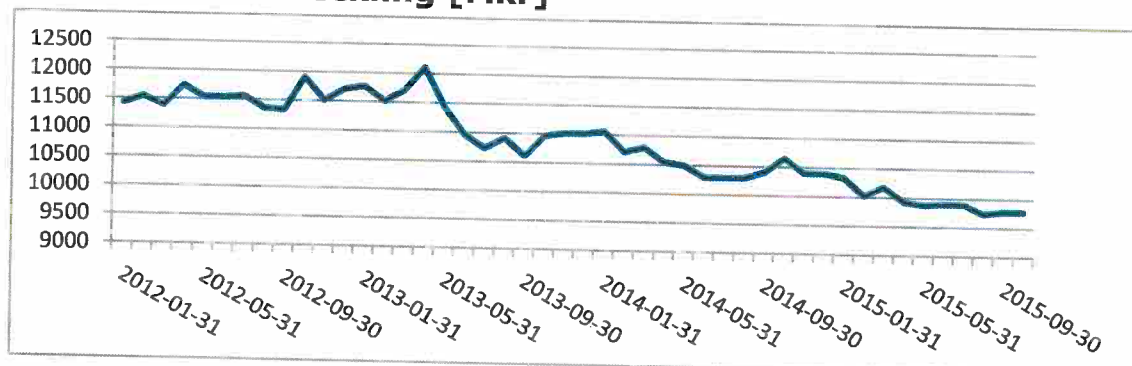
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,6 år	☑
LCR	≥ 80%	91%	☑
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	☑
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,4 år	☑
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	40%	☑
♦ 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)	15-10-31	15-09-30	14-12-31	Skulder (finansiering)	15-10-31	15-09-30	14-12-31
Placering Telge	10 467	10 529	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 425	4 424	4 590
Reverser Söderenergi	541	541	636	Certifikat, KC-programmet	950	950	1 100
Rev övr intressebolag	32	29	183	Övr. extern finansiering	4 409	4 409	4 711
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 358	1 370	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	102	55	289				
Summa IBs tillgångar	11 143	11 154	11 714	Summa IBs skulder	11 143	11 154	11 714

Extern skuld utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

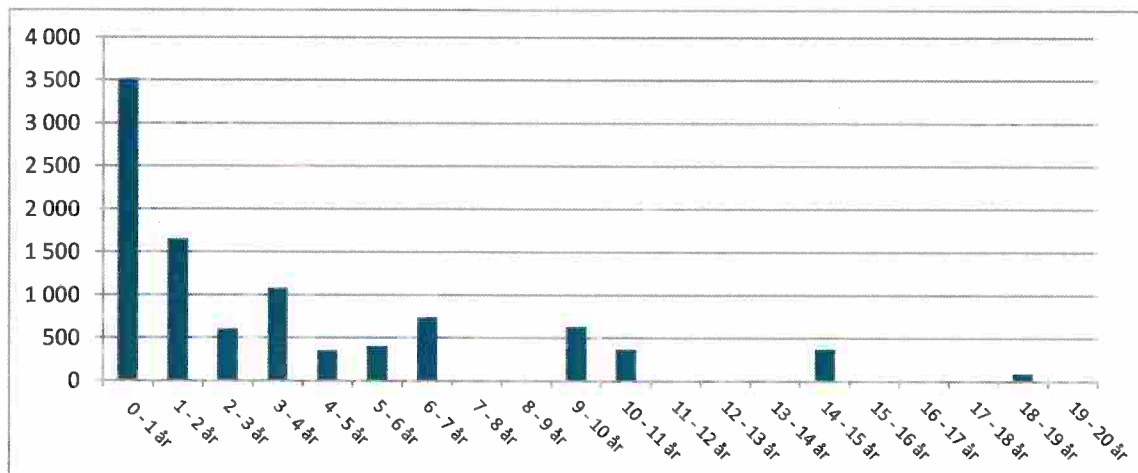
Datum	Genomsnittsränta
2015-01-31	2,90%
2015-02-28	2,89%
2015-03-31	2,85%
2015-04-30	2,74%
2015-05-31	2,71%
2015-06-30	2,67%
2015-07-31	2,49%
2015-08-31	2,31%
2015-09-30	2,17%
2015-10-31	2,23%

FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

[extern skuld totalt 9 784 Mkr]



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

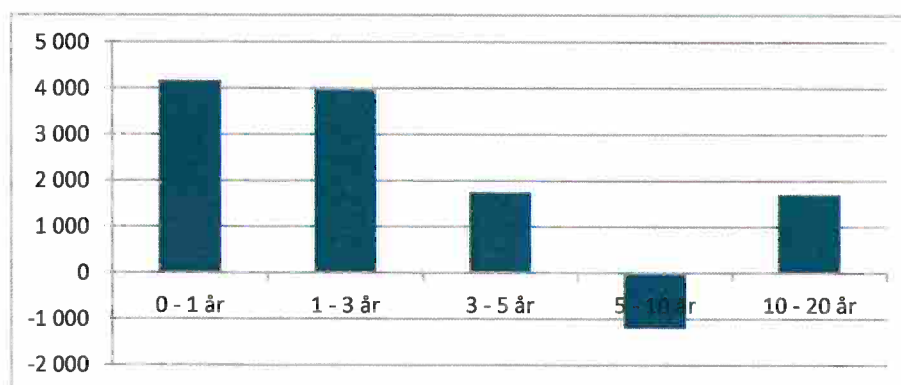
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	102,0	702,0	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0	0,0	
Totalt	3 100	102,0	3 202,0	

RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

[extern skuld plus 42% av Söderenergi AB leasingaffär, totalt 10 376 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	15-10-31	15-09-30
Bank 1	-196,2	-193,4
Bank 2	-5,2	-6,3
Bank 3	-55,1	-54,0
Bank 4	14,4	14,7
Bank 5	-75,2	-89,7
Bank 6	-67,4	-74,8
Bank 7	9,7	-3,4
Bank 8	-231,7	-231,8
Totalt	-606,6	-638,7

Placering av överskottslikviditet

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