

KS20150226

FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-01-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2016-02-26

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

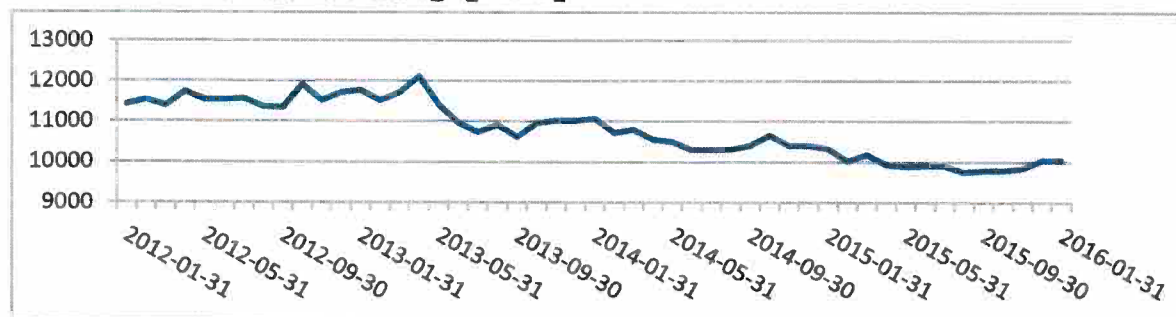
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,3 år	✓
LCR	≥ 80%	91%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	19 år	✓
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,8 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	42%	✓
♦ 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)	16-01-31	15-12-31	14-12-31	Skulder (finansiering)	16-01-31	15-12-31	14-12-31
Placering Telge	10 553	10 385	10 605	Obligationer, MTN-progr.	4 427	4 426	4 590
Reverser Söderenergi	586	586	636	Certifikat, KC-programmet	1 201	1 201	1 100
Rev övr intressebolag	31	31	183	Övr. extern finansiering	4 409	4 409	4 711
Reverser andra komm.	50	100	0	Kommunens egen likviditet	1 471	1 435	1 312
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	288	370	289				
Summa IBs tillgångar	11 507	11 471	11 714	Summa IBs skulder	11 507	11 471	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%
2015-11-30	2,24%
2015-12-31	2,26%
2016-01-31	2,22%



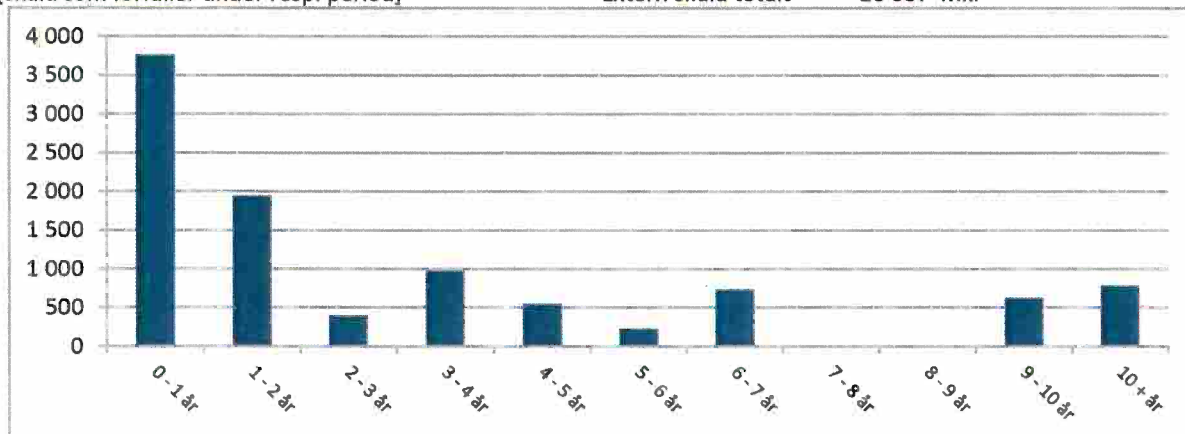
FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

10 037 Mkr



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

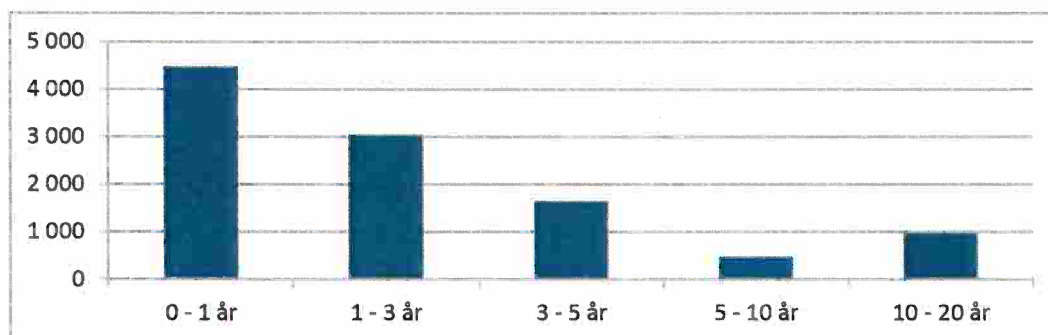
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	287,7	887,7	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		50,0		Ja
Totalt	3 100	337,7	3 437,7	

RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Extern skuld inkl. 42% av Söderenergi AB:s leasingaffär, totalt 10 623 Mkr



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	16-01-31	15-12-31
Bank 1	-211,8	-175,3
Bank 2	1,2	-14,9
Bank 3	-59,1	-112,5
Bank 4	25,4	18,1
Bank 5	-72,2	-71,9
Bank 6	-72,1	-89,4
Bank 7	13,9	9,6
Bank 8	-235,7	-202,8
Totalt	-610,4	-639,0

Placering av överskottslikviditet

Motpart	Tot. löptid	Belopp (Mkr)	Inom limit/tillåten rating?
Huddinge kommun	12 dagar	50,0	Ja
Totalt		50,0	