

FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-02-29

Till kommunstyrelsens sammanträde 2016-04-01

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

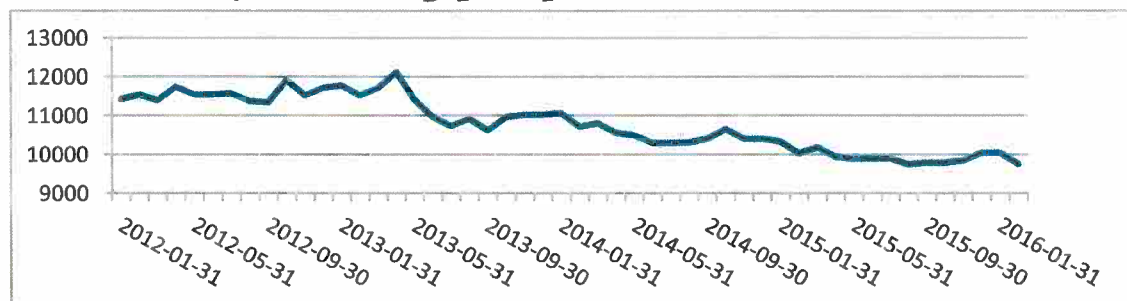
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,3 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	≥ 80%	98%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	18 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,9 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	41%	<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)	16-02-29	16-01-31	15-12-31	Skulder (finansiering)	16-02-29	16-01-31	15-12-31
Placering Telge	10 383	10 553	10 385	Obligationer, MTN-progr.	4 177	4 427	4 426
Reverser Söderenergi	586	586	586	Certifikat, KC-programmet	1 161	1 201	1 201
Rev övr intressebolag	31	31	31	Övr. extern finansiering	4 409	4 409	4 409
Reverser andra komm.	0	50	100	Kommunens egen likviditet	1 565	1 471	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	313	288	370				
Summa IBs tillgångar	11 312	11 507	11 471	Summa IBs skulder	11 312	11 507	11 471

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%
2016-02-29	2,22%

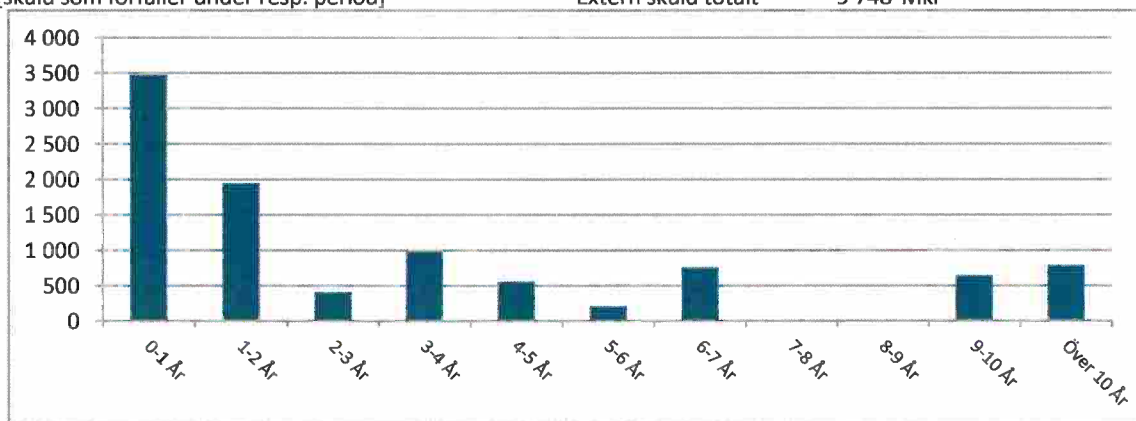
FINANSIERINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

9 748 Mkr



Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

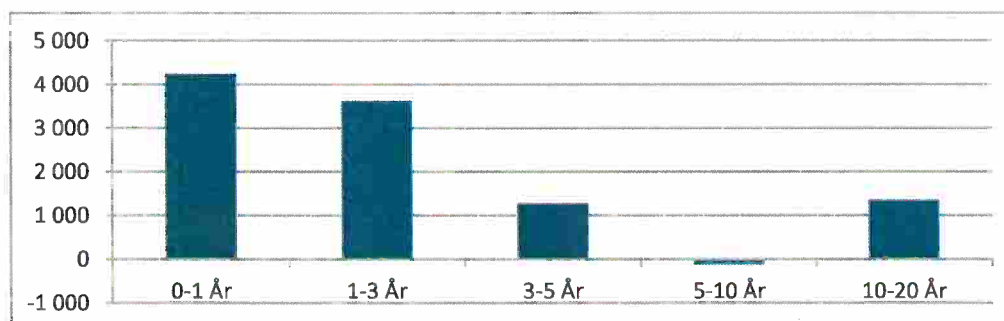
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	312,9	912,9	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	312,9	3 412,9	

RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Extern skuld inkl. 42% av Söderenergi AB:s leasingaffär, totalt 10 334 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	16-02-29	16-01-31
Bank 1	-229,5	-211,8
Bank 2	9,2	1,2
Bank 3	-61,5	-59,1
Bank 4	31,6	25,4
Bank 5	-71,8	-72,2
Bank 6	-76,1	-72,1
Bank 7	21,5	13,9
Bank 8	-252,5	-235,7
Totalt	-629,1	-610,4

Placering av överskottslikviditet

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