

## FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-03-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2016-04-29

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

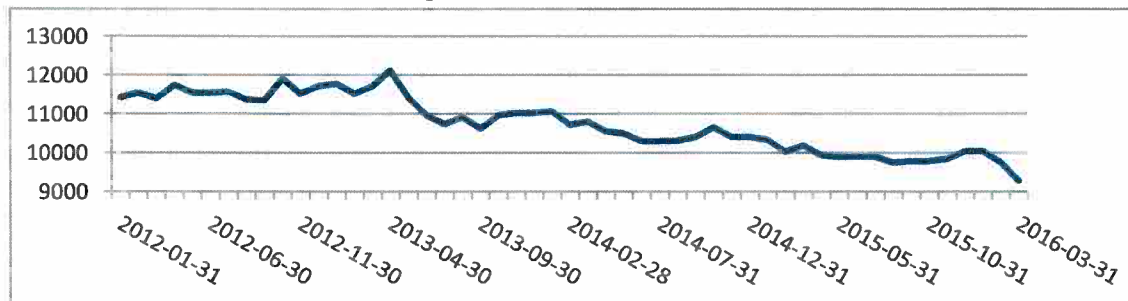
### SAMMANFATTNING

Kontrolli mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,5 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	≥ 80%	110%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	18 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	3,0 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	38%	<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)	16-03-31	16-02-29	15-12-31	Skulder (finansiering)	16-03-31	16-02-29	15-12-31
Placering Telge	10 200	10 383	10 385	Obligationer, MTN-progr.	3 679	4 177	4 426
Reverser Söderenergi	514	586	586	Certifikat, KC-programmet	1 262	1 161	1 201
Rev övr intressebolag	31	31	31	Övr. extern finansiering	4 341	4 409	4 409
Reverser andra komm.	0	0	100	Kommunens egen likviditet	1 487	1 565	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	23	313	370				
<b>Summa IBs tillgångar</b>	<b>10 768</b>	<b>11 312</b>	<b>11 471</b>	<b>Summa IBs skulder</b>	<b>10 768</b>	<b>11 312</b>	<b>11 471</b>

### 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%
2016-03-31	2,31%

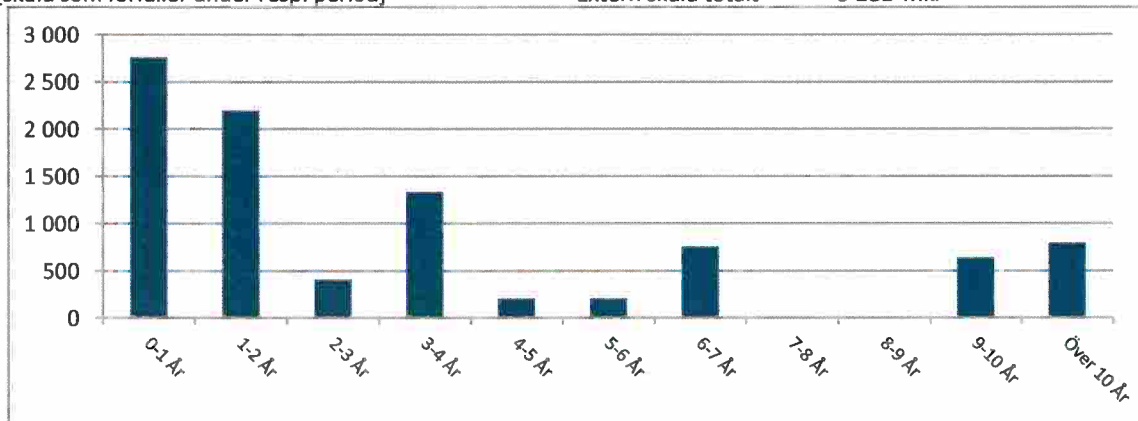
## FINANSIERINGSRISK

### Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

9 281 Mkr



### Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	22,8	622,8	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
<b>Totalt</b>	<b>3 100</b>	<b>22,8</b>	<b>3 122,8</b>	

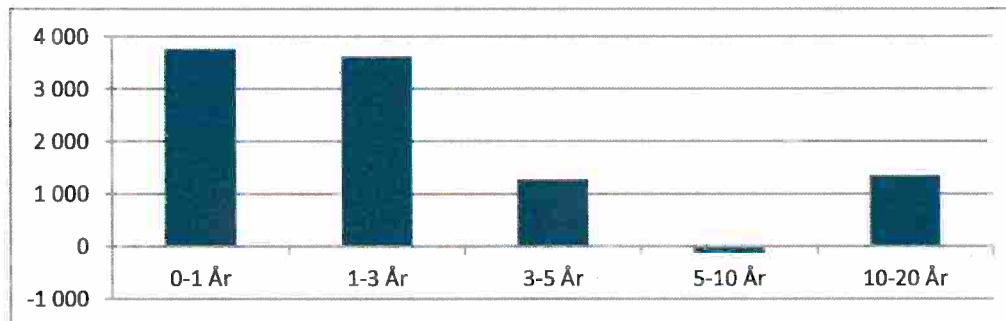
## RÄNTERISK

### Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

9 862 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	16-03-31	16-02-29
Bank 1	-220,6	-229,5
Bank 2	8,1	9,2
Bank 3	-69,4	-61,5
Bank 4	28,2	31,6
Bank 5	-69,7	-71,8
Bank 6	0,0	-76,1
Bank 7	17,8	21,5
Bank 8	-243,0	-252,5
<b>Totalt</b>	<b>-548,7</b>	<b>-629,1</b>

### Placering av överskottslikviditet

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