

# FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-05-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2016-06-17

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

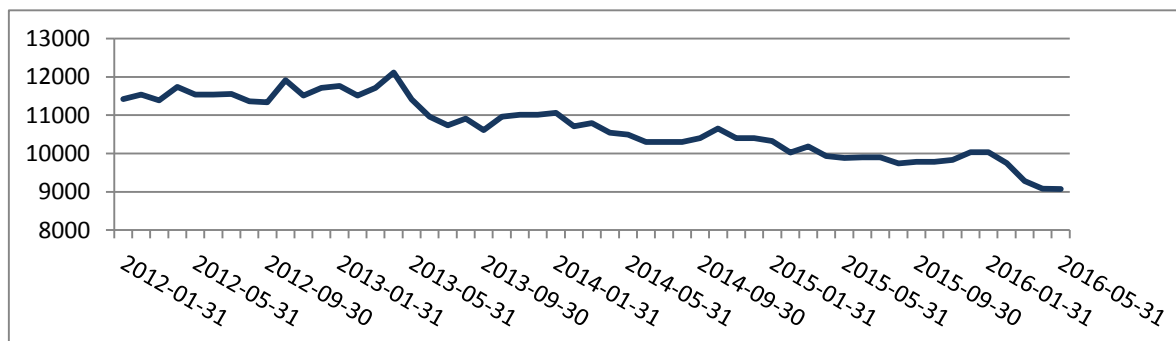
## SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kapitalbindningstid (vägt genomsnitt)	3 - 5 år	3,5 år	☑
LCR	≥ 80%	111%	☑
Längsta kap.bindningstid på lån	≤ 20 år	18 år	☑
Räntebindningstid (vägt genomsnitt)	2 - 5 år	2,6 år	☑
Ränteförfall inom 12 månader	25 - 60%	51%	☑
♦ 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)	16-05-31	16-04-30	15-12-31	Skulder (finansiering)	16-05-31	16-04-30	15-12-31
Placering Telge	10 001	10 047	10 385	Obligationer, MTN-progr.	3 130	3 479	4 426
Reverser Söderenergi	493	493	586	Certifikat, KC-programmet	1 602	1 262	1 201
Reverser Täljehallen	31	31	31	Övr. extern finansiering	4 341	4 341	4 409
Reverser andra komm.	40	0	100	Kommunens egen likviditet	1 580	1 492	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	87	3	370				
<b>Summa IBs tillgångar</b>	<b>10 653</b>	<b>10 574</b>	<b>11 471</b>	<b>Summa IBs skulder</b>	<b>10 653</b>	<b>10 574</b>	<b>11 471</b>

## Extern skuld, utveckling [Mkr]



## Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2016-04-30	2,33%
2016-05-31	2,34%

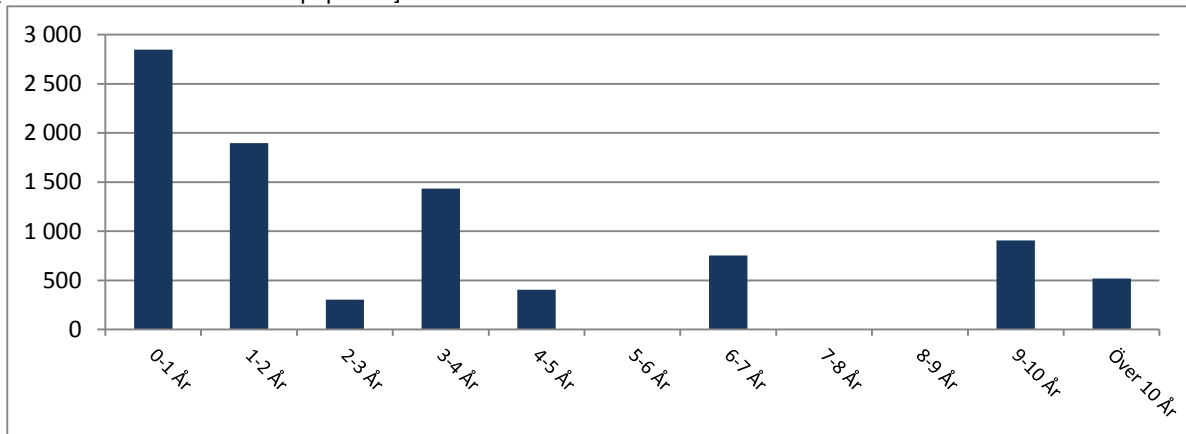
## FINANSIERINGSRISK

### Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

9 072 Mkr



### Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

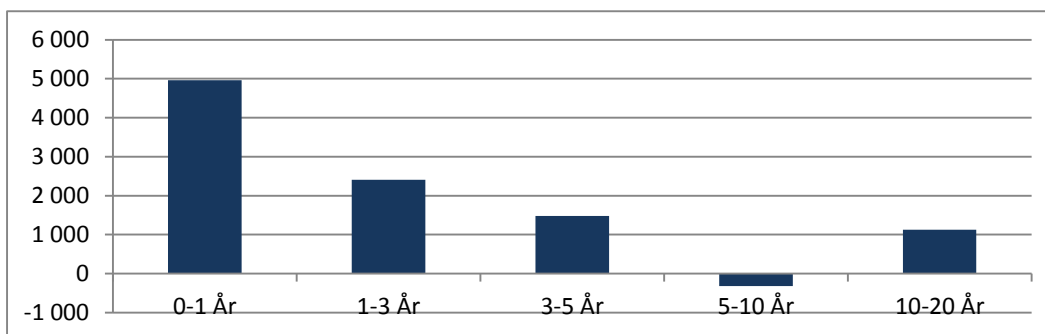
	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	87,3	687,3	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
<b>Totalt</b>	<b>3 100</b>	<b>87,3</b>	<b>3 187,3</b>	

## RÄNTERISK

### Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Extern skuld inkl. 42% av Söderenergi AB:s leasingaffär, totalt 9 654 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	16-05-31	16-04-30
Bank 1	-226,6	-214,2
Bank 2	14,4	4,1
Bank 3	-66,3	-70,5
Bank 4	28,5	23,6
Bank 5	-67,4	-68,3
Bank 6	14,0	12,2
Bank 7	-241,8	-232,8
<b>Totalt</b>	<b>-545,1</b>	<b>-545,7</b>

### Placering av överskottslikviditet

Motpart	Tot. löptid	Belopp (Mkr)	Inom limit/tillåten rating?
Huddinge kommun	mindre än 30 dagar	40,0	Ja
<b>Totalt</b>		<b>40,0</b>	