



15.10.2016

FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-10-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2016-11-25

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

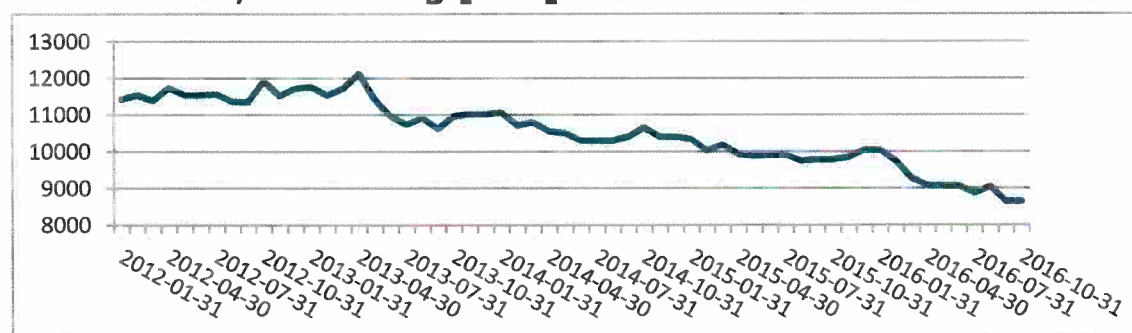
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	37%	<input checked="" type="checkbox"/>
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,4 år	<input checked="" type="checkbox"/>
LCR	Min 80%	94%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Räntebindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	3,0 år	<input checked="" type="checkbox"/>
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	56%	<input checked="" type="checkbox"/>
Andel variabel räntebindning	Max 20%	15%	<input checked="" type="checkbox"/>
Längsta räntebindningstid på enskild affär	Max 20 år	17 år	<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finanspolicy.			<input checked="" type="checkbox"/>
♦ Kreditrisker vid placering av eventuell överskottslikviditet och vid derivataffärer har hanterats enligt regler i Finanspolicy.			<input checked="" type="checkbox"/>

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utfäst)	16-10-31	16-09-30	15-12-31	Skulder (finansiering)	16-10-31	16-09-30	15-12-31
Placering Telge	9 705	9 828	10 385	Obligationer, MTN-progr.	3 134	3 133	4 426
Reverser Söderenergi	544	523	586	Certifikat, KC-programmet	1 275	1 275	1 201
Reverser Täljehallen	31	31	31	Övr. extern finansiering	4 240	4 240	4 409
Reverser andra komm.	0	0	100	Kommunens egen likviditet	1 739	1 696	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	108	-38	370				
Summa IBs tillgångar	10 387	10 344	11 471	Summa IBs skulder	10 387	10 344	11 471

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2016-06-30	2,33%
2016-07-31	2,40%
2016-08-31	2,46%
2016-09-30	2,48%
2016-10-31	2,64%

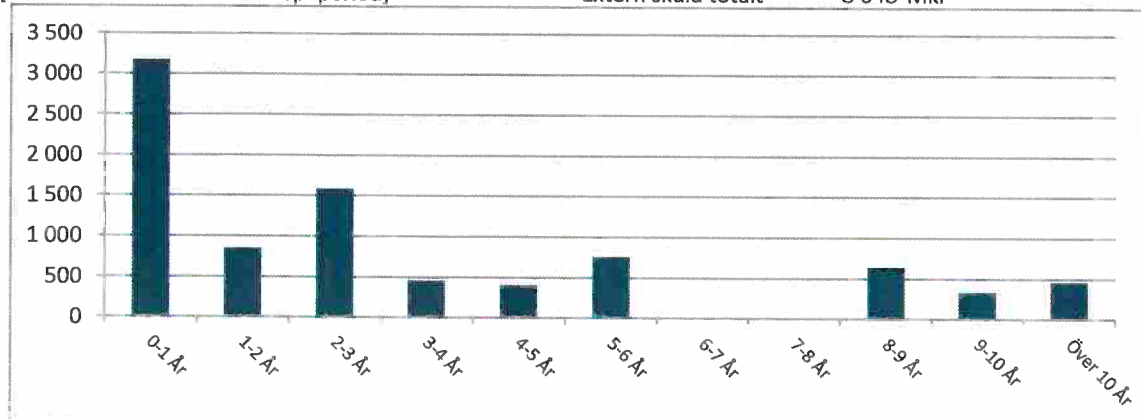
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 648 Mkr



LIKVIDITETSRIK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	108,1	708,1	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	108,1	3 208,1	

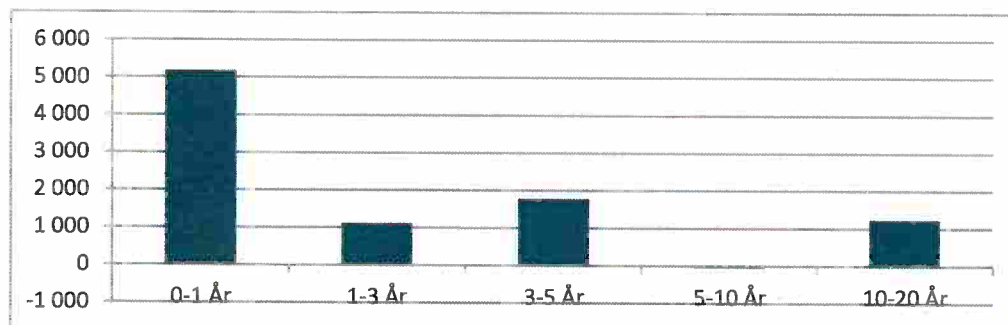
RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

Extern skuld inkl. 42% av Söderenergi AB:s leasingaffär, totalt 9 218

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.



KREDITRISK

Marknadsvärden, derivat [Mkr]

- netto per motpart, negativt värde medför ingen kreditrisk

Motpart	16-10-31	16-09-30
Bank 1	-262,7	-274,5
Bank 2	41,6	50,9
Bank 3	32,9	7,8
Bank 4	58,5	51,5
Bank 5	-59,8	-63,7
Bank 6	30,2	26,0
Bank 7	-260,8	-274,1
Totalt	-420,2	-476,0

Placering av överskottslikviditet

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