

FINANSIELL RISKRAPPORT 2017-01-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-02-24

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

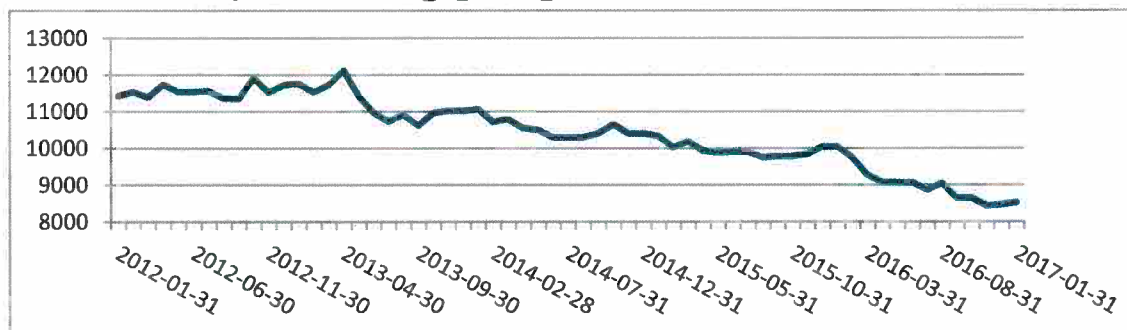
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	39%	✓
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,3 år	✓
LCR	Min 80%	92%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	✓
Räntebindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	3,0 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	49%	✓
Andel variabel räntebindning	Max 20%	15%	✓
Längsta räntebindningstid på enskild affär	Max 20 år	17 år	✓
♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finanspolicy.			✓
♦ Kreditrisk vid placering av eventuell överskottslikviditet och vid derivataffärer har hanterats enligt regler i Finanspolicy.			✓

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	17-01-31	16-12-31	15-12-31	Skulder (finansiering)	17-01-31	16-12-31	15-12-31
Placering Telge	9 533	9 535	10 385	Obligationer, MTN-progr.	3 136	3 135	4 426
Reverser Söderenergi	565	586	586	Certifikat, KC-programmet	1 150	1 050	1 201
Reverser Täljehallen	30	30	31	Övr. extern finansiering	4 239	4 279	4 409
Reverser andra komm.	0	0	100	Kommunens egen likviditet	1 798	1 779	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	196	92	370				
Summa IBs tillgångar	10 323	10 243	11 471	Summa IBs skulder	10 323	10 243	11 471

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2016-11-30	2,54%
2016-12-31	2,59%
2017-01-31	2,63%



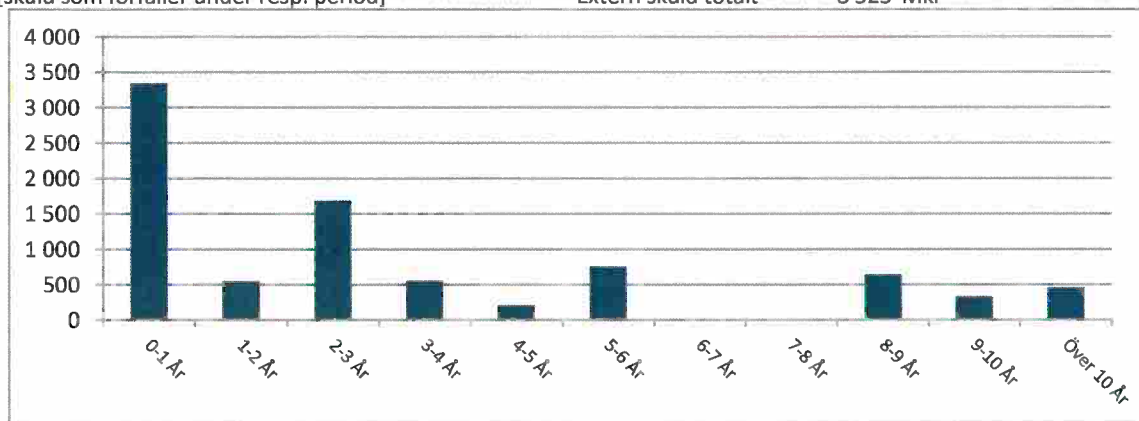
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 525 Mkr



LIKVIDITETSRISK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	195,7	795,7	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	195,7	3 295,7	

RÄNTERISK

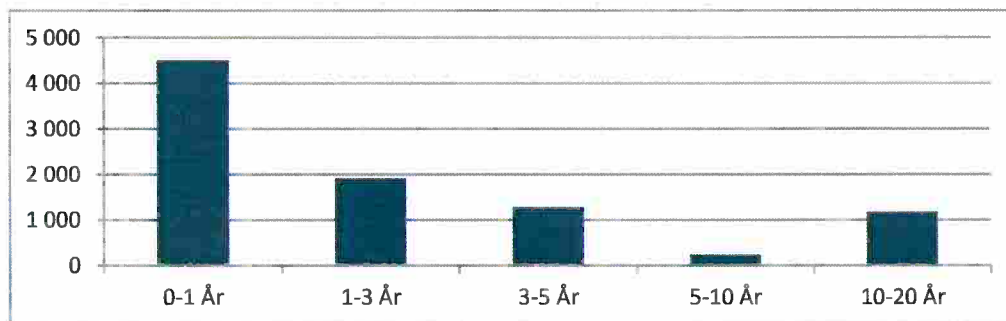
Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

9 089

Mkr



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	17-01-31	16-12-31
Bank 1	-100,4	-103,8
Bank 2	11,8	22,5
Bank 3	-29,8	-25,5
Bank 4	-69,9	-72,9
Bank 5	-50,0	-53,3
Bank 6	12,4	20,1
Bank 7	-179,0	-197,7
Totalt	-404,9	-410,5

Placering av överskottslikviditet

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