

KS20170331

FINANSIELL RISKRAPPORT 2017-02-28

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-03-31

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

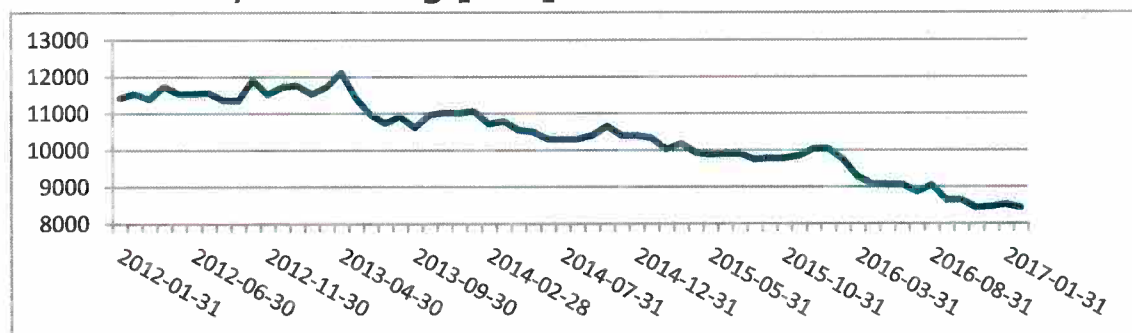
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	36%	☑
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,3 år	☑
LCR	Min 80%	105%	☑
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	☑
Räntebindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	2,9 år	☑
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	40%	☑
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.			☑
♦ Kreditrisker vid placering av eventuell överskottslikviditet och vid derivataffärer har hanterats enligt regler i Finanspolicy.			☑

INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	17-02-28	17-01-31	16-12-31	Skulder (finansiering)	17-02-28	17-01-31	16-12-31
Placering Telge	9 473	9 533	9 535	Obligationer, MTN-progr.	3 386	3 136	3 135
Reverser Söderenergi	544	565	586	Certifikat, KC-programmet	800	1 150	1 050
Reverser Täljehallen	30	30	30	Övr. extern finansiering	4 239	4 239	4 279
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 906	1 798	1 779
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	285	196	92				
Summa IBs tillgångar	10 332	10 323	10 243	Summa IBs skulder	10 332	10 323	10 243

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
2016-03-31	2,24%
2016-04-30	2,33%
2016-05-31	2,26%
2016-06-30	2,33%
2016-07-31	2,32%
2016-08-31	2,38%
2016-09-30	2,48%
2016-10-31	2,55%
2016-11-30	2,54%
2016-12-31	2,51%
2017-01-31	2,55%
2017-02-28	2,53%

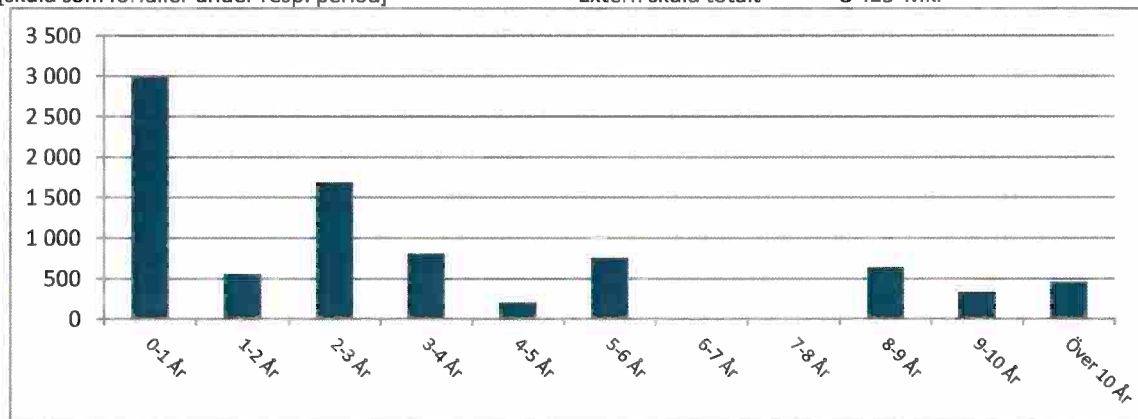
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 425 Mkr



LIKVIDITETSRIK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	285,1	885,1	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	285,1	3 385,1	

RÄNTERISK

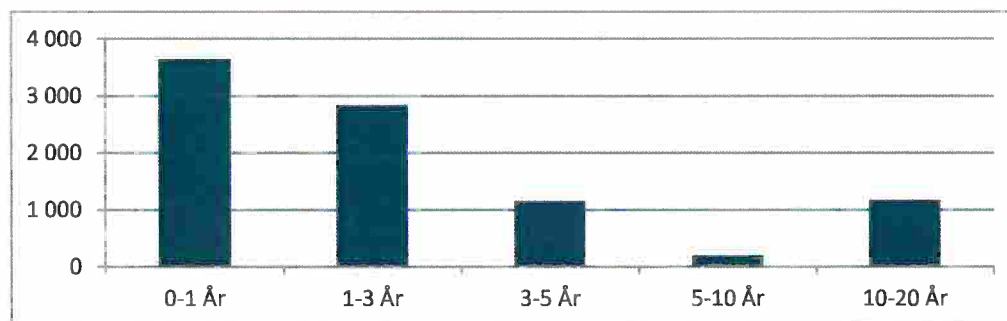
Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

8 990

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	17-02-28	17-01-31
Bank 1	-101,7	-100,4
Bank 2	25,9	11,8
Bank 3	-12,7	-29,8
Bank 4	-88,0	-69,9
Bank 5	-47,8	-50,0
Bank 6	14,3	12,4
Bank 7	-198,0	-179,0
Totalt	-408,2	-404,9

Placering av överskottslikviditet

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