

KS 2017/0428

FINANSIELL RISKRAPPORT 2017-03-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-04-28

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

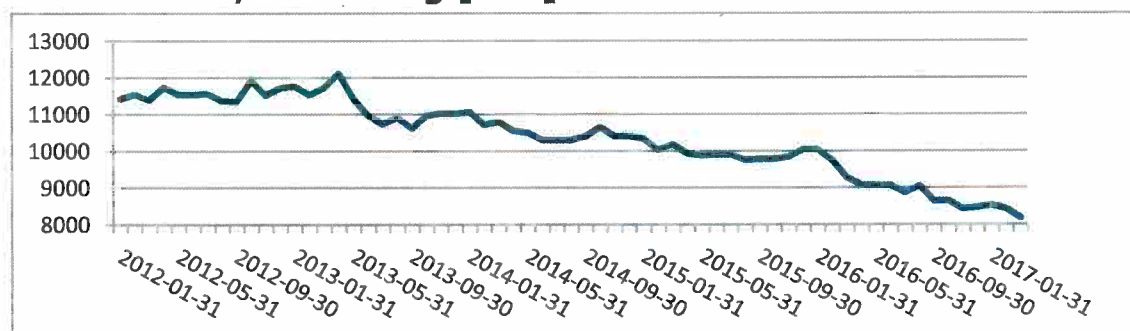
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	37%	✓
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,4 år	✓
LCR	Min 80%	97%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	✓
Räntebindingstid (genomsnitt)	2 - 5 år	2,8 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	42%	✓
Andel variabel räntebinding	Max 20%	16%	✓
Längsta räntebindingstid 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)	17-03-31	17-02-28	16-12-31	Skulder (finansiering)	17-03-31	17-02-28	16-12-31
Placering Telge	9 506	9 473	9 535	Obligationer, MTN-progr.	3 387	3 386	3 135
Reverser Söderenergi	523	544	586	Certifikat, KC-programmet	800	800	1 050
Reverser Täljehallen	30	30	30	Övr. extern finansiering	3 988	4 239	4 279
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 898	1 906	1 779
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	15	285	92				
Summa IBs tillgångar	10 074	10 332	10 243	Summa IBs skulder	10 074	10 332	10 243

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2017-03-31	2,61%



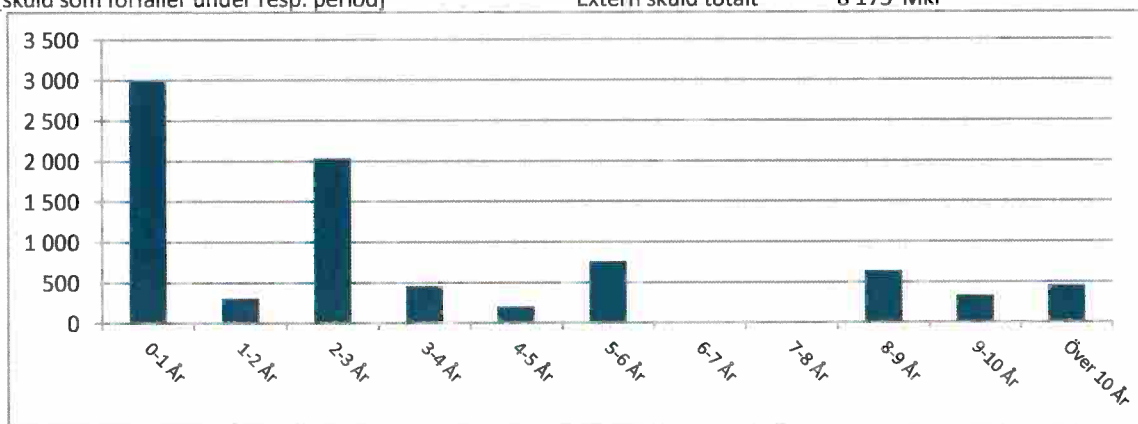
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 175 Mkr



LIKVIDITETSRISK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	14,6	614,6	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	14,6	3 114,6	

RÄNTERISK

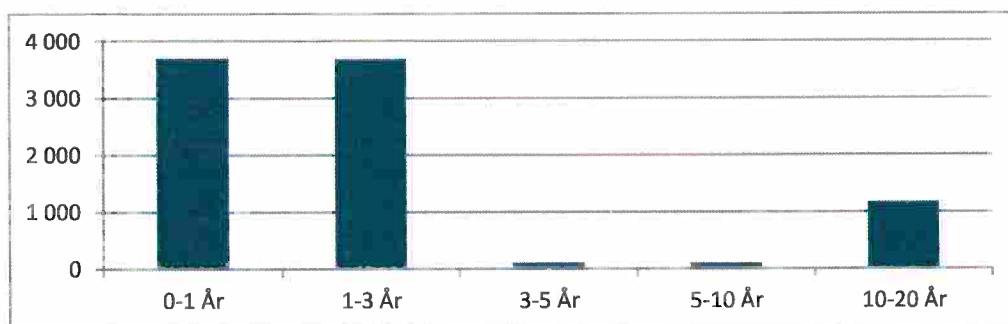
Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

8 731

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	17-03-31	17-02-28
Bank 1	-97,6	-101,7
Bank 2	23,3	25,9
Bank 3	-40,8	-12,7
Bank 4	-94,5	-88,0
Bank 5	-45,7	-47,8
Bank 6	8,1	14,3
Bank 7	-191,9	-198,0
Totalt	-439,2	-408,2

Placering av överskottslikviditet

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