

KS20170524

FINANSIELL RISKRAPPORT 2017-04-30

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-05-24

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

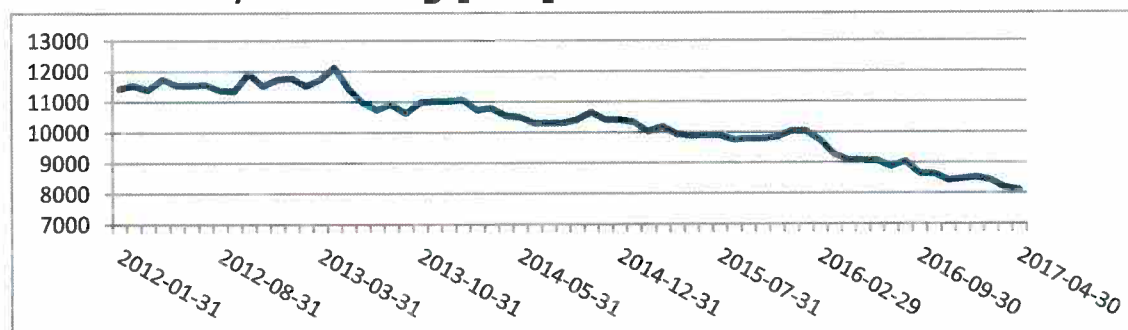
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	36%	✓
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,4 år	✓
LCR	Min 80%	100%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	✓
Räntebindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	2,7 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	42%	✓
Andel variabel räntebindning	Max 20%	16%	✓
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)	17-04-30	17-03-31	16-12-31	Skulder (finansiering)	17-04-30	17-03-31	16-12-31
Placering Telge	9 502	9 506	9 535	Obligationer, MTN-progr.	3 216	3 387	3 135
Reverser Söderenergi	523	523	586	Certifikat, KC-programmet	1 100	800	1 050
Reverser Täljehallen	30	30	30	Övr. extern finansiering	3 788	3 988	4 279
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	1 974	1 898	1 779
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	23	15	92				
Summa IBs tillgångar	10 078	10 074	10 243	Summa IBs skulder	10 078	10 074	10 243

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2017-04-30	2,62%



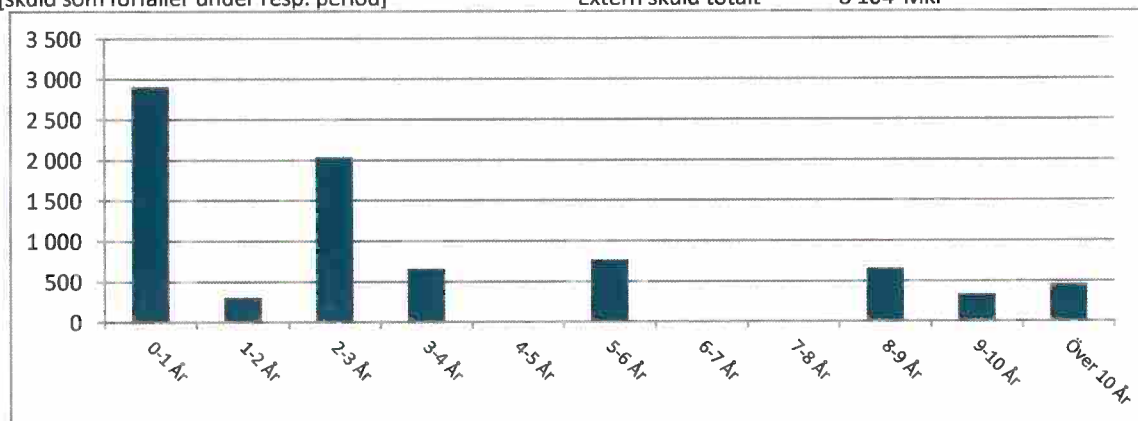
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 104 Mkr



LIKVIDITETSRISK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	22,8	622,8	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	22,8	3 122,8	

RÄNTERISK

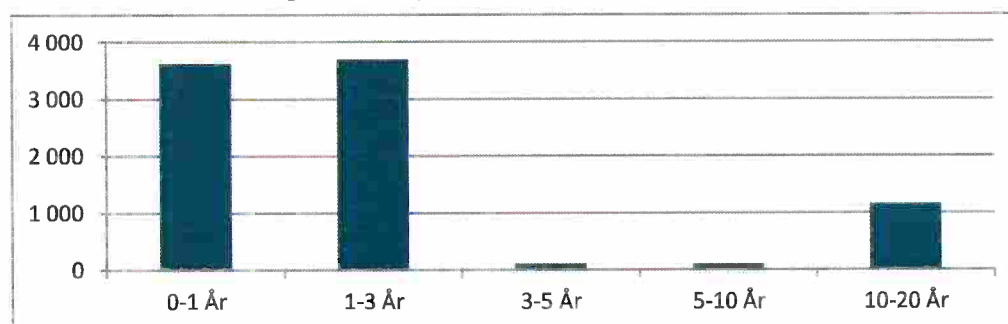
Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

8 659

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	17-04-30	17-03-31
Bank 1	-95,8	-97,6
Bank 2	25,3	23,3
Bank 3	-49,9	-40,8
Bank 4	-94,3	-94,5
Bank 5	-42,9	-45,7
Bank 6	8,5	8,1
Bank 7	-193,0	-191,9
Totalt	-442,1	-439,2

Placering av överskottslikviditet

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