

FINANSIELL RISKRAPPORT 2017-05-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-06-16

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

Riskrapporten och riskmätningen är till viss del förändrad i och med uppdaterad finanspolicy beslutad av kommunfullmäktige 2017-05-29.

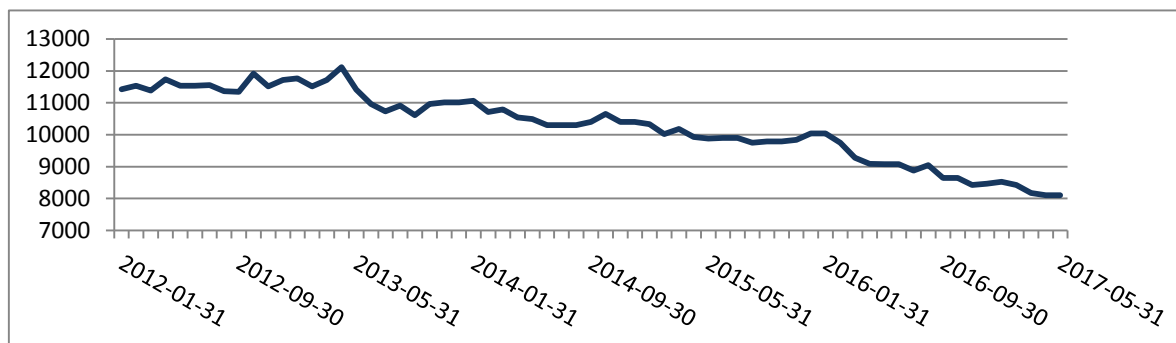
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	36%	☑
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	3,3 år	☑
LCR	Min 80%	103%	☑
Räntebindningstid (genomsnitt, nom skuld)	2 - 5 år	3,2 år	☑
Ränteförfall inom 12 månader (nom skuld)	Max 60%	31%	☑
Andel real skuld	Max 20%	16%	☑
♦ 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)	17-05-31	17-04-30	16-12-31	Skulder (finansiering)	17-05-31	17-04-30	16-12-31
Placering Telge	9 438	9 502	9 535	Obligationer, MTN-progr.	3 216	3 216	3 135
Reverser Söderenergi	523	523	586	Certifikat, KC-programmet	1 100	1 100	1 050
Reverser Täljehallen	30	30	30	Övr. extern finansiering	3 788	3 788	4 279
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	2 007	1 974	1 779
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	121	23	92				
Summa IBs tillgångar	10 112	10 078	10 243	Summa IBs skulder	10 112	10 078	10 243

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
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%
2017-05-31	2,68%

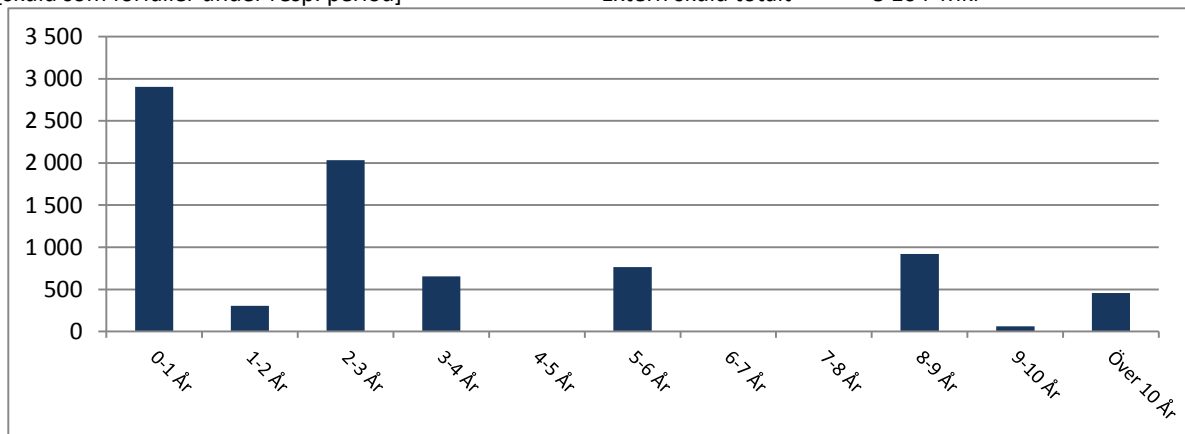
UPPLÅNINGSRISK

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	120,7	720,7	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	120,7	3 220,7	

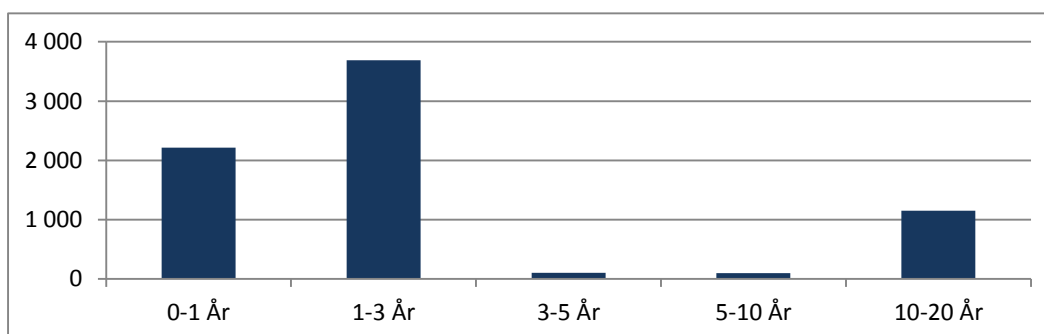
RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

7 253 Mkr



Mätningen av finansieringsrisken och ränterisken sker på olika belopp på grund av att den reala skulden exkluderas vid mätning av ränterisk samt att leasingaffärerna påverkar ränterisken men inte finansieringsrisken och räntesäkras.

KREDITRISK

Marknadsvärden, derivat [Mkr]

- netto per motpart, negativt värde medför ingen kreditrisk

Motpart	17-05-31	17-04-30
Bank 1	-95,0	-95,8
Bank 2	29,6	25,3
Bank 3	-46,4	-49,9
Bank 4	-94,3	-94,3
Bank 5	-40,1	-42,9
Bank 6	10,5	8,5
Bank 7	-197,5	-193,0
Totalt	-433,3	-442,1

Placering av överskottslikviditet

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