

# FINANSIELL RISKRAPPORT 2018-05-31

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

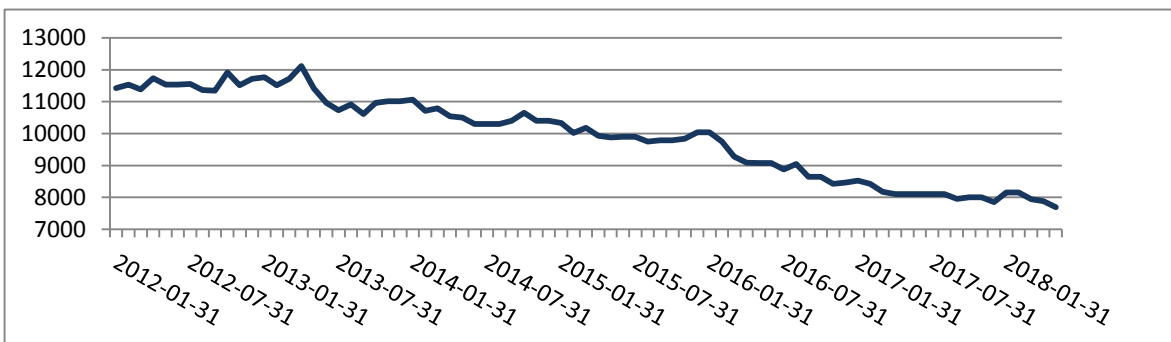
## SAMMANFATTNING

| Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:   | Tillåtet intervall | Verkligt |   |
|---|--------------------|----------|---|
| Kort upplåning (0-12 mån)   | Max 50%            | 36%      | ✓ |
| Kapitalbindningstid (genomsnitt)  | 2 - 5 år           | 2,7 år   | ✓ |
| LCR   | Min 80%            | 106%     | ✓ |
| Räntebindningstid (genomsnitt, nom skuld)   | 2 - 5 år           | 2,4 år   | ✓ |
| Ränteförfall inom 12 månader (nom skuld)  | Max 60%            | 56%      | ✓ |
| Andel real skuld  | Max 20%            | 18%      | ✓ |
| ♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finanspolicy.   |                    |          | ✓ |
| ♦ Kreditrisker vid placering av eventuell överskottslikviditet och vid derivataffärer har hanterats enligt regler i Finanspolicy. |                    |          | ✓ |

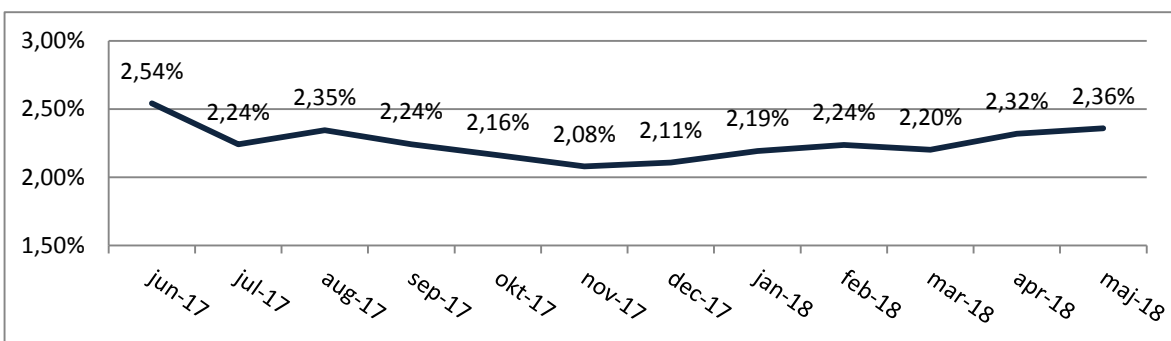
## INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

| Tillgångar (utlåning)       | 18-05-31      | 18-04-30      | 17-12-31      | Skulder (finansiering)    | 18-05-31      | 18-04-30      | 17-12-31      |
|-----------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| Placering Telge             | 9 547         | 9 611         | 9 490         | Obligationer, MTN-progr.  | 2 852         | 2 852         | 2 816         |
| Reverser Söderenergi        | 462           | 483           | 556           | Certifikat, KC-programmet | 2 450         | 2 645         | 2 100         |
| Reverser Täljehallen        | 30            | 30            | 30            | Övr. extern finansiering  | 2 385         | 2 385         | 2 936         |
| Reverser andra komm.        | 0             | 0             | 0             | Kommunens egen likviditet | 2 388         | 2 392         | 2 228         |
| Övriga kortfr plac.         | 0             | 0             | 0             | Nyttjad checkkredit       | 0             | 0             | 0             |
| Saldo koncernkonto          | 37            | 151           | 4             |                           |               |               |               |
| <b>Summa IBs tillgångar</b> | <b>10 075</b> | <b>10 274</b> | <b>10 080</b> | <b>Summa IBs skulder</b>  | <b>10 075</b> | <b>10 274</b> | <b>10 080</b> |

## Extern skuld, utveckling [Mkr]



## Genomsnittsränta på extern skuld [act/360]



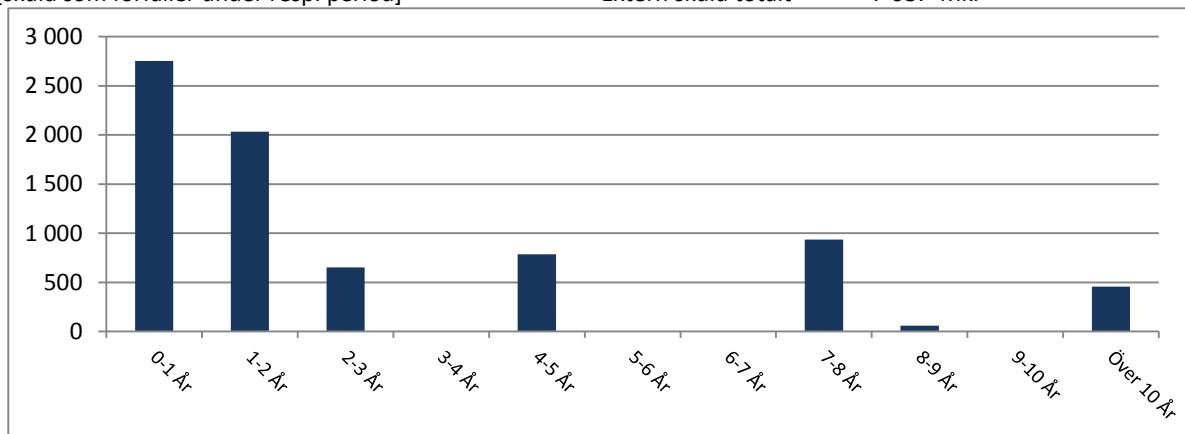
## UPPLÅNINGSRISK

### Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

7 687 Mkr



## LIKVIDITETSRISK

### Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

|               | Avtalsbelopp | Saldo       | Kvar att utn.  | Ratingkrav uppfyllt? |
|---------------|--------------|-------------|----------------|----------------------|
| Checkkrediter | 600          | 36,5        | 636,5          | Ja                   |
| Kreditlöften  | 2 500        | 0,0         | 2 500,0        | Ja                   |
| Placering     |              | 0,0         |                |                      |
| <b>Totalt</b> | <b>3 100</b> | <b>36,5</b> | <b>3 136,5</b> |                      |

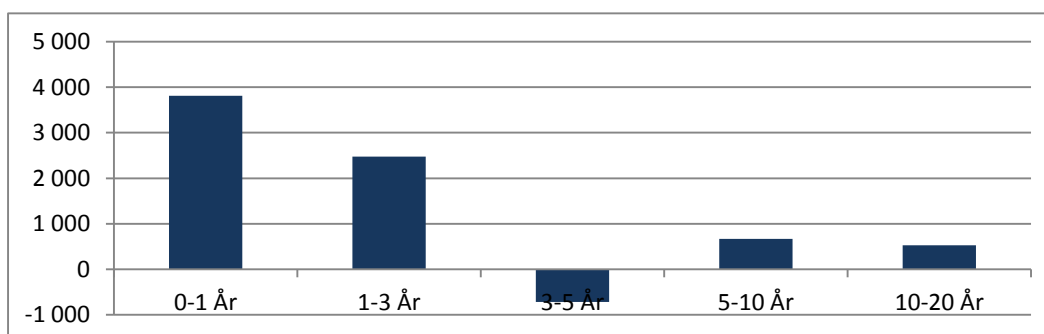
## RÄNTERISK

### Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

6 763 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       | 18-05-31      | 18-04-30      | 17-12-31      |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Bank 1        | -63,5         | -65,9         | -75,4         |
| Bank 2        | 9,3           | 5,9           | 6,8           |
| Bank 3        | -13,3         | 8,6           | -84,3         |
| Bank 4        | -59,0         | -29,5         | -82,1         |
| Bank 5        | -35,3         | -35,3         | -36,3         |
| Bank 6        | 20,6          | 30,0          | 15,6          |
| Bank 7        | -151,1        | -149,7        | -158,6        |
| <b>Totalt</b> | <b>-292,3</b> | <b>-235,9</b> | <b>-414,4</b> |

### Extern placering av ev. tillfällig överskottslikviditet

| Motpart       | Tot. löptid | Belopp (Mkr) | Inom limit/tillåten rating? |
|---------------|-------------|--------------|-----------------------------|
| <b>Totalt</b> |             | <b>0,0</b>   |                             |