

FINANSIELL RISKRAPPORT 2019-01-31

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

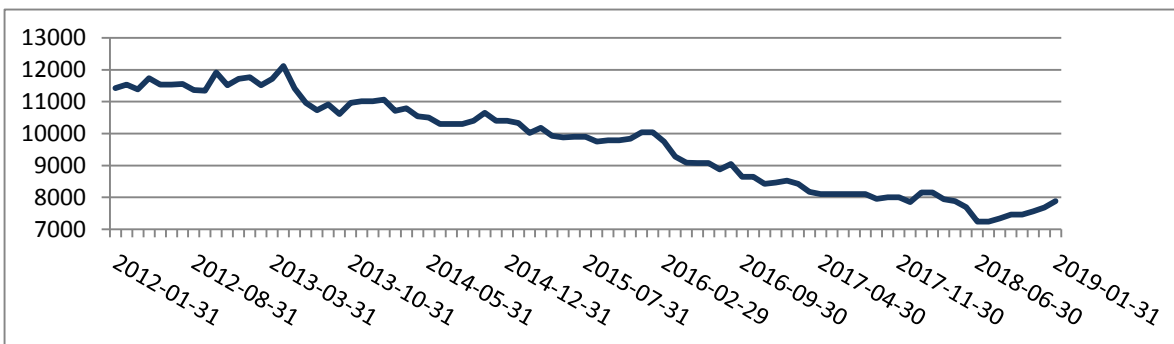
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finanspolicy angående:	Tillåtet intervall	Utfall	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	50%	✓
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	2,5 år	✓
LCR	Min 80%	84%	✓
Räntebindningstid (genomsnitt, nom skuld)	2 - 5 år	3,5 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader (nom skuld)	Max 60%	43%	✓
Andel real skuld	Max 20%	17%	✓
♦ Valutarisk i finansverksamheten har säkrats enligt regler i Finanspolicy.			✓
♦ Kreditrisker vid placering av eventuell överskottslikviditet och vid derivataffärer har hanterats enligt regler i Finanspolicy.			✓

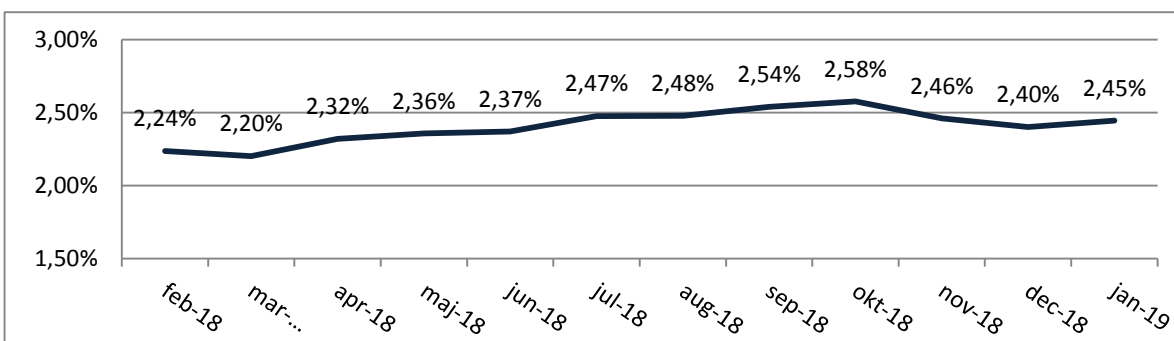
INTERNBANKENS TILLGÅNGAR OCH SKULDER [Mkr]

Tillgångar (utlåning)	19-01-31	18-12-31	17-12-31	Skulder (finansiering)	19-01-31	18-12-31	17-12-31
Placering Telge	9 411	9 313	9 490	Obligationer, MTN-progr.	2 852	2 852	2 816
Reverser Söderenergi	634	634	556	Certifikat, KC-programmet	1 945	1 745	2 100
Reverser Täljehallen	29	29	30	Övr. extern finansiering	3 083	3 083	2 936
Reverser andra komm.	0	0	0	Kommunens egen likviditet	2 351	2 393	2 228
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	157	97	4				
Summa IBs tillgångar	10 231	10 073	10 080	Summa IBs skulder	10 231	10 073	10 080

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld [act/360]



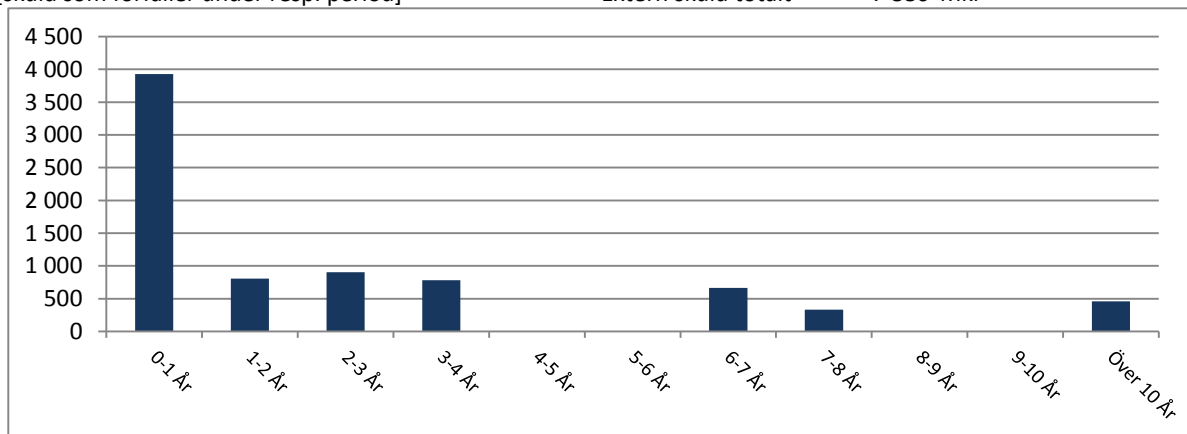
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

7 880 Mkr



LIKVIDITETSRISK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	300	156,9	456,9	Ja
Kreditlöften	3 000	0,0	3 000,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 300	156,9	3 456,9	

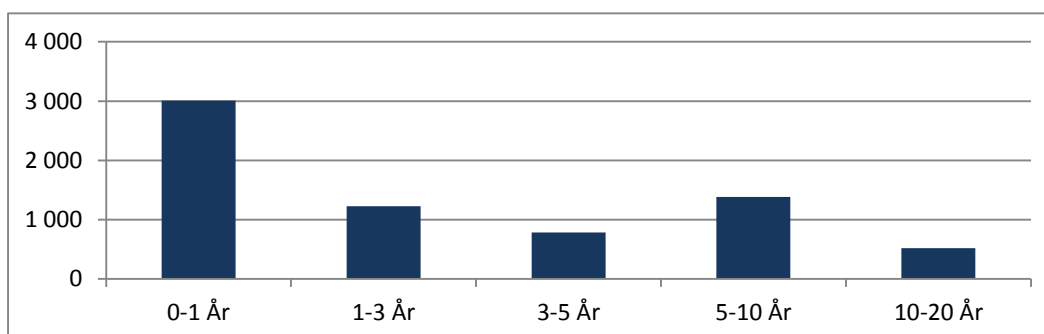
RÄNTERISK

Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

6 926 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	19-01-31	18-12-31	17-12-31
Bank 1	-51,3	-51,3	-75,4
Bank 2	6,2	6,2	6,8
Bank 3	-67,2	-67,2	-84,3
Bank 4	-35,6	-45,9	-82,1
Bank 5	-34,6	-34,6	-36,3
Bank 6	22,9	22,9	15,6
Bank 7	-139,0	-136,9	-158,6
Totalt	-298,6	-306,8	-414,4

Extern placering av ev. tillfällig överskottslikviditet

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