

FINANSIELL RISKRAPPORT 2016-12-31

Till kommunstyrelsens sammanträde 2017-01-27

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

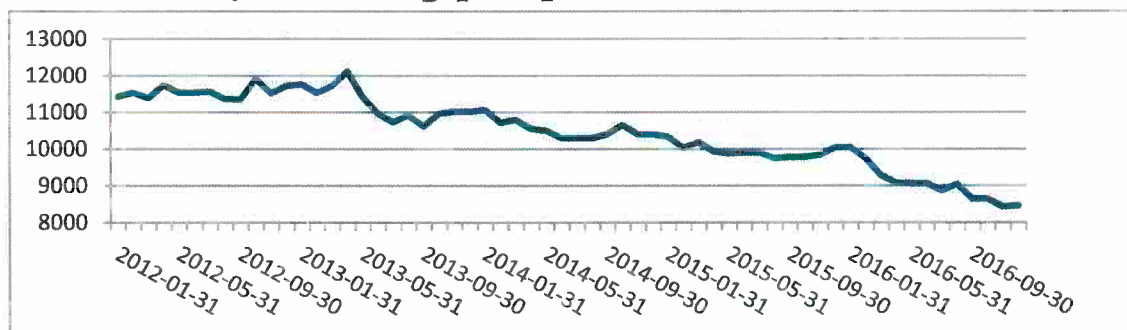
SAMMANFATTNING

Kontroll mot Finansiella föreskrifter angående:	Tillåtet intervall	Verkligt	
Kort upplåning (0-12 mån)	Max 50%	39%	✓
Kapitalbindningstid (genomsnitt)	3 - 5 år	3,4 år	✓
LCR	Min 80%	91%	✓
Längsta kap.bindningstid på lån	Max 20 år	17 år	✓
Räntebindningstid (genomsnitt)	2 - 5 år	3,0 år	✓
Ränteförfall inom 12 månader	Max 60%	49%	✓
Andel variabel räntebindning	Max 20%	15%	✓
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)	16-12-31	16-11-30	15-12-31	Skulder (finansiering)	16-12-31	16-11-30	15-12-31
Placering Telge	9 535	9 548	10 385	Obligationer, MTN-progr.	3 135	3 134	4 426
Reverser Söderenergi	586	544	586	Certifikat, KC-programmet	1 050	1 050	1 201
Reverser Täljehallen	30	31	31	Övr. extern finansiering	4 279	4 240	4 409
Reverser andra komm.	0	0	100	Kommunens egen likviditet	1 779	1 792	1 435
Övriga kortfr plac.	0	0	0	Nyttjad checkkredit	0	0	0
Saldo koncernkonto	92	94	370				
Summa IBs tillgångar	10 243	10 216	11 471	Summa IBs skulder	10 243	10 216	11 471

Extern skuld, utveckling [Mkr]



Genomsnittsränta på extern skuld

Datum	Genomsnittsränta
2016-01-31	2,22%
2016-02-29	2,22%
2016-03-31	2,31%
2016-04-30	2,33%
2016-05-31	2,34%
2016-06-30	2,33%
2016-07-31	2,40%
2016-08-31	2,46%
2016-09-30	2,48%
2016-10-31	2,64%
2016-11-30	2,54%
2016-12-31	2,59%

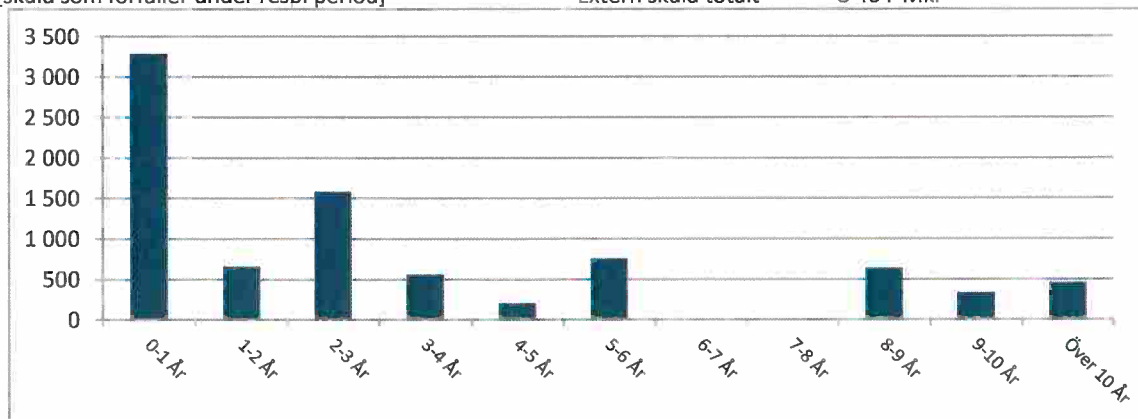
UPPLÅNINGSRISK

Förfalloprofil kapitalbindning [Mkr]

[skuld som förfaller under resp. period]

Extern skuld totalt

8 464 Mkr



LIKVIDITETSRISK

Kommunkoncernens betalningsberedskap [Mkr]

	Avtalsbelopp	Saldo	Kvar att utn.	Ratingkrav uppfyllt?
Checkkrediter	600	91,5	691,5	Ja
Kreditlöften	2 500	0,0	2 500,0	Ja
Placering		0,0		
Totalt	3 100	91,5	3 191,5	

RÄNTERISK

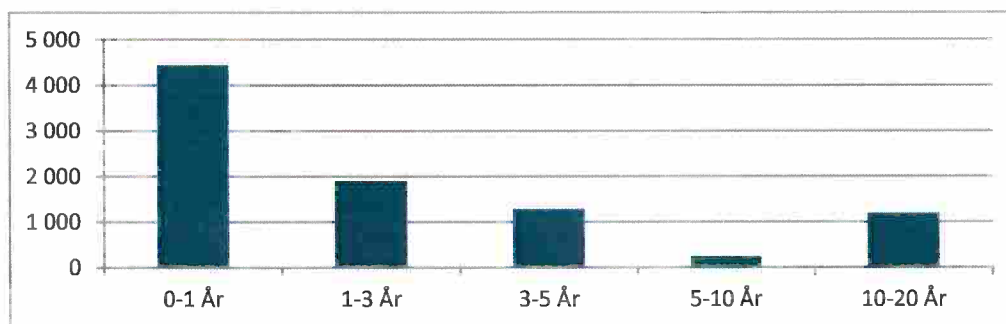
Förfalloprofil räntebindning [Mkr]

[skuldräntor som kommer att ändras under resp. period]

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

9 028

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	16-12-31	16-11-30
Bank 1	-103,8	-107,2
Bank 2	22,5	25,1
Bank 3	-25,5	11,9
Bank 4	-72,9	-64,1
Bank 5	-53,3	-56,2
Bank 6	20,1	25,1
Bank 7	-197,7	-202,1
Totalt	-410,5	-367,6

Placering av överskottslikviditet

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