

# FINANSIELL RISKRAPPORT

## VÄSTERÅS KOMMUNKONCERN

### 2022-11-30



VÄSTERÅS STAD

### Sammanfattning skuld- och tillgångsförvaltning

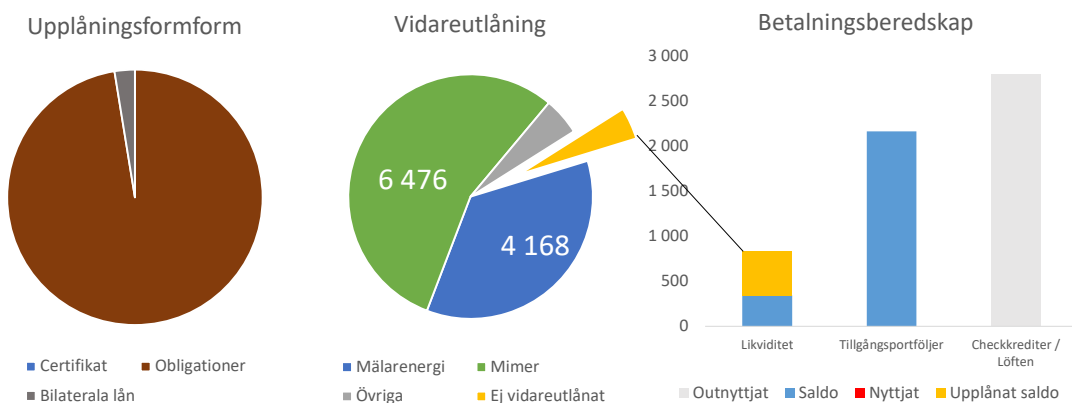
Samtliga regler för skuldförvaltning som anges i Västerås Stads Finanspolicy efterlevs

**Beslut angående räntesäkringar:** Ekonomidirektörens sedan maj månad utfärdade undantag för räntesäkringsinstrumentens (ränteswapparnas)marknadsvärde per motpart löper fram tills 2022-12-31. I och med att marknadsvärdena fortfarande överstiger den befintliga limiten och förväntas göra detta för en längre tid framåt har ett nytt beslut fattats av Ekonomidirektören om att förlänga undantaget fram tills 2023-03-31. *Marknadsvärdet av swapparna speglar den ökade räntekostnad staden haft över tid utan dessa swappar, för närvarande mellan 0 och 282 mnkr per motpart, totalt ca 640mnkr. Stadens risk relaterar de vid värderingstillfället avtalsmässiga ränteflöden som kunde gått förlorade vid momentan konkurs av stadens affärsmotparter, alla med godkänd rating och omfattade av EU:s bankresolutionsdirektiv. Motparternas kreditrating och marknadsmässiga kreditrisk bevakas löpande.*

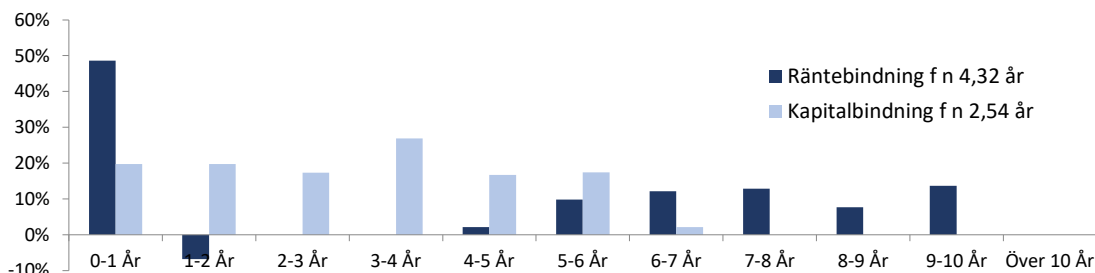
Skuldportföljens utveckling (mnkr)	2022-11-30	2022-10-31	IB 2022
Koncernens externa upplåning	11 724	11 724	11 419
Snittränta extern upplåning (inkl derivat)	1,39%	1,34%	0,55%

Tillgångsportföljernas utveckling (mnkr)		2022-11-30	utv. 1 mån	utv. i år
Pensionsportföljen	marknadsvärde	1 489	2,1%	-9,8%
Kulturfonden	marknadsvärde	166	2,9%	-9,0%
Asköviksfonden	marknadsvärde	3	3,1%	-7,0%
Likviditetsportfölj	marknadsvärde	508	1,0%	-6,3%
Tillgångsportföljer totalt		2 166		

### Skuldförvaltning



### Kapital- och räntebindning Västerås kommunkoncern



# FINANSIELL RISKRAPPORT

## VÄSTERÅS KOMMUNKONCERN

### 2022-11-30



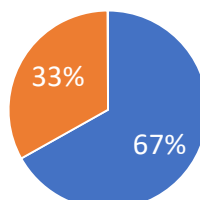
VÄSTERÅS STAD

### Tillgångsförvaltning

Samtliga placeringsregler i Västerås Stads  
Finanspolicy gällande etik och hållbarhet efterlevs

Samtliga allokeringsregler i Västerås Stads  
Finanspolicy efterlevs

Allokering pensionsportföljen

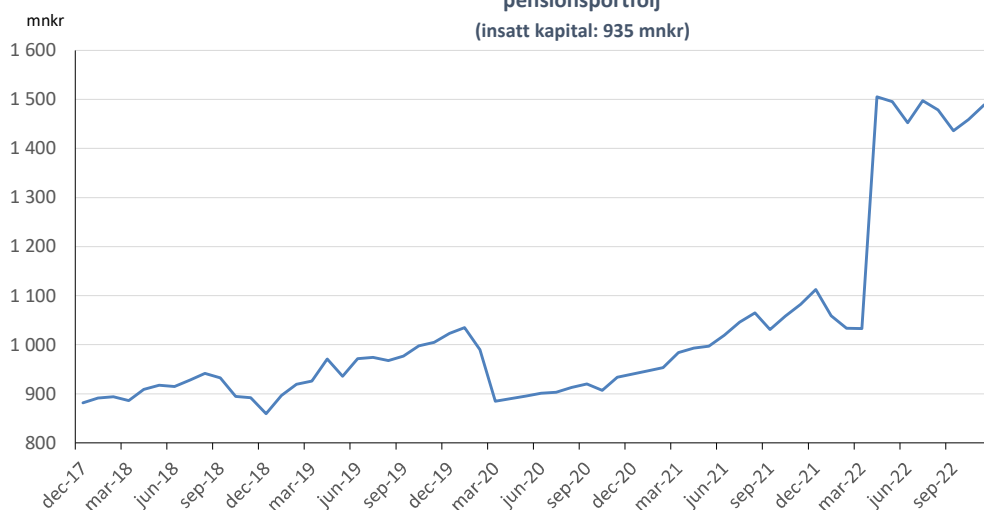


■ Räntebärande värdepapper ■ Aktier ■ Likvida medel

### Pensionsportföljen

Tillgångsslag	Marknadsvärde (mnr)	Utveckling 1 mån	Andel	Duration
<b>Räntebärande värdepapper</b>	<b>996,0</b>	<b>0,7%</b>	<b>67%</b>	<b>1,3 år</b>
<b>Aktier</b>	<b>492,5</b>		<b>33%</b>	
- varav svenska aktier	133,1	7,6%		
- varav utländska aktier	359,4	3,9%		
<b>Likvida medel</b>	<b>0,6</b>		<b>0%</b>	
<b>Totalt</b>	<b>1 489,1</b>	<b>2,1%</b>		

Marknadsvärde  
pensionsportfölj  
(insatt kapital: 935 mnr)



Under april månad 2022 flyttades 500 mnr från Likviditetsportfölj till Pensionsmedelsportfölj.