

FINANSIELL RISKRAPPORT

VÄSTERÅS KOMMUNKONCERN

2022-05-31



VÄSTERÅS STAD

Sammanfattning skuld- och tillgångsförvaltning

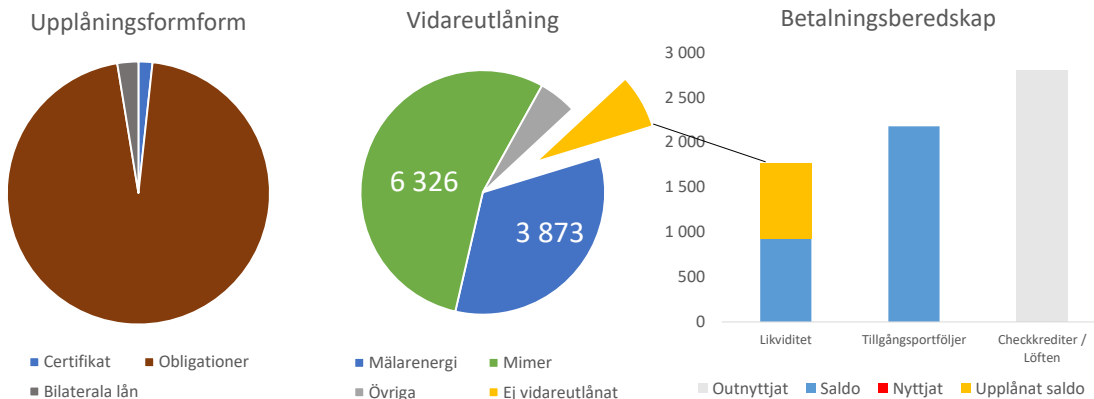
Samtliga regler för skuldförvaltning som anges i Västerås Stads Finanspolicy efterlevs ✔

Kommentar: Under maj månad beslutade ekonomidirektör Hans Nyström om avsteg från Finanspolicyen avseende motpartsrisk. Marknadsvärdet av de räntederivat som kommunen har ingått har kraftigt ökat i värde i takt med vårens ränteturbulens, detta har fallit ut strategiskt mycket väl för kommunen och dämpar därmed marknadens påverkan på finansnetto på kort och lång sikt. För ett fortsatt handlingsutrymme och för fortsatt effektiv portföljhantering har ett tidsbegränsat beslut till slutet av 2022 fattats. För att sprida riskerna arbetar vi aktivt med portföljens struktur och har också knutit till oss ytterligare en affärsmotpart under perioden.

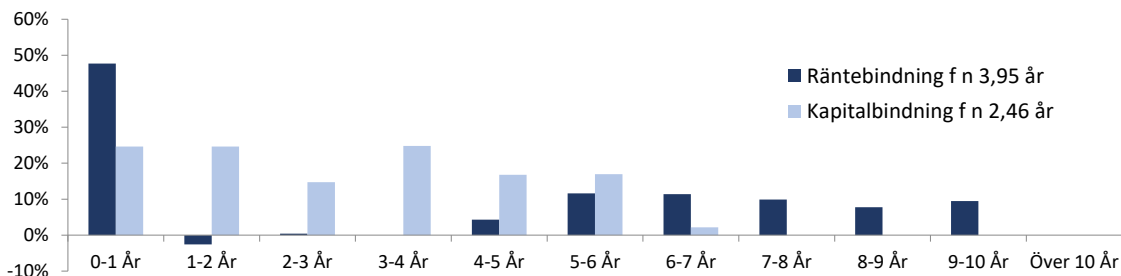
Skuldportföljens utveckling (mnkr)	2022-05-31	2022-04-30	IB 2022
Koncernens externa upplåning	11 617	11 099	11 419
Snittränta extern upplåning (inkl derivat)	0,62%	0,62%	0,55%

Tillgångsportföljernas utveckling (mnkr)	2022-05-31	utv. 1 mån	utv. i år
Pensionsportföljen	marknadsvärde 1 496	-0,7%	-9,4%
Kulturfonden	marknadsvärde 165	-1,2%	-9,8%
Asköviksfonden	marknadsvärde 3	-0,9%	-8,1%
Likviditetsportfölj	marknadsvärde 513	-0,6%	-5,7%
Tillgångsportföljer totalt	2 176		

Skuldförvaltning



Kapital- och räntebindning Västerås kommunkoncern



2022-05-31



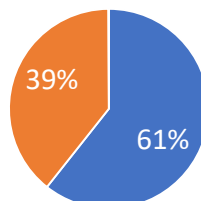
VÄSTERÅS STAD

Tillgångsförvaltning

Samtliga placeringsregler i Västerås Stads
Finanspolicy gällande etik och hållbarhet efterlevs

Samtliga allokeringsregler i Västerås Stads
Finanspolicy efterlevs

Allokering pensionsportföljen

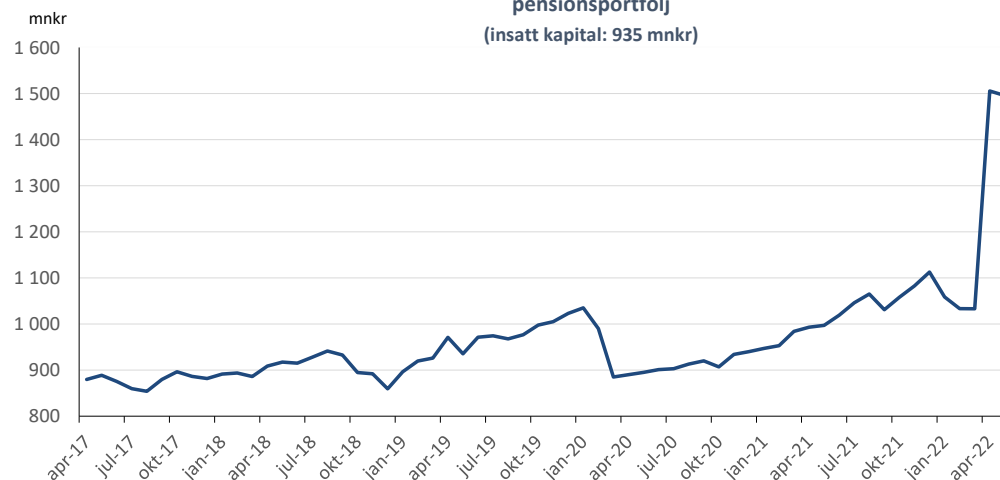


■ Räntebärande värdepapper ■ Aktier ■ Likvida medel

Pensionsportföljen

Tillgångsslag	Marknadsvärde (mnr)	Utveckling 1 mån	Andel	Duration
Räntebärande värdepapper	907,0	-1%	61%	1,6 år
Aktier	587,6		39%	
- varav svenska aktier	168,5	-1,9%		
- varav utländska aktier	419,1	0,9%		
Likvida medel	1,0		0%	
Totalt	1 495,7	-0,7%		

Marknadsvärde
pensionsportfölj
(insatt kapital: 935 mnr)



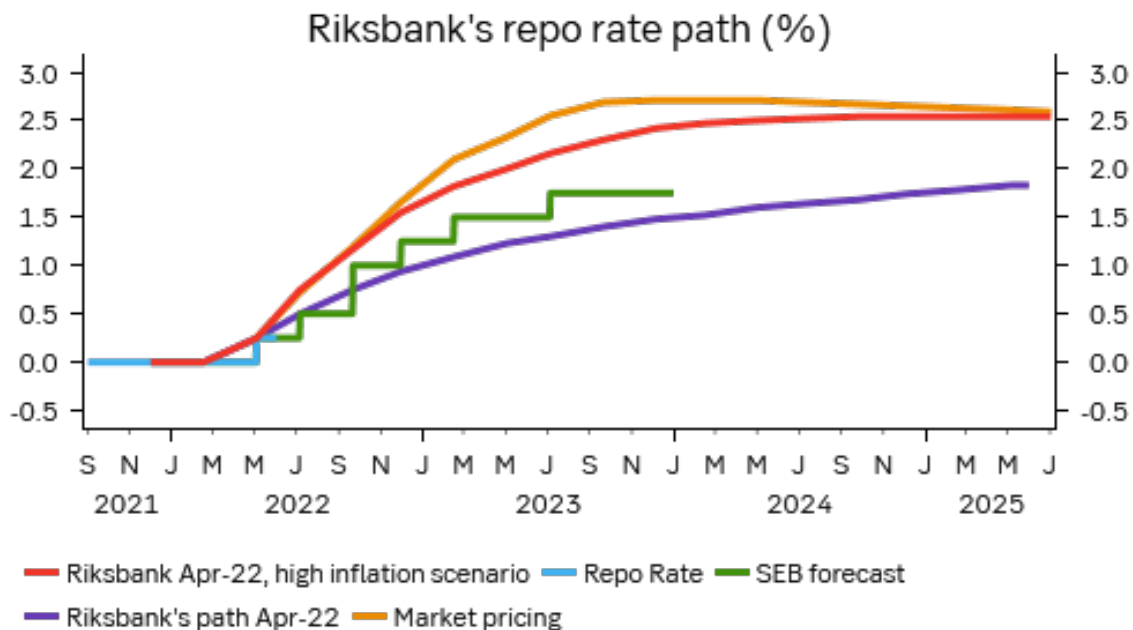
Under april månad 2022 flyttades 500 mnr från Likviditetsportfölj till Pensionsmedelsportfölj.

Bilaga till Internbankens månadsrapport per 2022-05-31

Marknadskommentar 2022-06-07:

Svenska räntor har fortsatt stiga något under maj månad. Fortsatt höga inflationsutfall globalt gör att marknaden fortsätter att prissätta aggressiva räntehöjningar från världens centralbanker.

Analytiker ställer sig fortfarande tveksamma till om svensk ekonomi skulle klara av en så pass snabb höjningstakt och de flesta tror fortfarande att räntehöjningarna kan avta en bit in i 2023.



Staden håller fortsatt en relativt låg andel aktier i portföljerna. Marknadsvärdet i pensionsportföljen var den 31 maj cirka 1 496 mnkr, en minskning med cirka 9,4 % sedan årsskiftet. Likviditetsportföljen hade ett marknadsvärde på cirka 513 mnkr, en minskning med 5,7 % sedan årsskiftet

Efterfrågan på stadens värdepapper är fortsatt god. Staden har hög likviditet och Internbanken har förfinansierat vårens och sommarens förfall.