



Sveriges statsskuld

30 september 2016

STATSSKULD

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
A. Nominellt belopp, inkl. förvaltningsstillgångar	-40 816 027 045	1 209 222 654 499
Upplupen inflationskompensation (uppräkningsbelopp)	393 844 851	19 451 455 936
Valutakurseffekter	-1 089 236 926	36 356 467 632
B. Nominellt uppräknat belopp till aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar	-41 511 419 120	1 265 030 578 067
Förvaltningstillgångar, aktuell valutakurs	-31 935 283 232	27 136 948 022
Officiellt mått på statens bruttoskuld:		
C. STATSSKULD	-73 446 702 352	1 292 167 526 089

STATENS SKULD INKL. VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
Vidareutlåning	17 001 524 568	-252 308 310 977
Förvaltningstillgångar	31 935 283 232	-27 136 948 022
D. STATENS SKULD INKLUSIVE VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR	-24 509 894 552	1 012 722 267 090

Statsskulden beräknas som värdet av utestående skuldinstrument, i huvudsak obligationer och statsskuldväxlar, vid rapporteringstidpunkten beräknat enligt fastlagda principer; se nedan. Inom ramen för skuldförvaltningen finns också vissa tillgångar. Det är medel som tillfälligt placeras på penningmarknaden till dess de används för att betala utgifter i statsbudgeten eller förfallande lån. Tillgångarna innebär att den reella skulden är mindre än summan av utestående skuldinstrument. I denna rapport presenteras både skulder och tillgångar eftersom vår ambition är att uppnå en rättvisande och transparent redovisning av statens skuldsättning.

Nominellt belopp (under A ovan) avser summan av de belopp som Riksgälden åtar sig att betala när ett skuldinstrument förfaller respektive erhåller vid förfall om det är frågan om en tillgång. Beloppet redovisas i kronor till valutakursen vid upplåningstillfället. Nästa steg i beräkningen av statsskulden (under B ovan) är att redovisa de nominella beloppen till aktuell valutakurs och lägga till upplupen inflationskompensation avseende utestående reala statsobligationer (Uppräknat belopp). Dessa mått visar statens skuld när hänsyn tas till de tillgångar som hanteras inom skuldförvaltningen.

Det officiella måttet på statsskulden (under C ovan) är definierat utifrån principer fastlagda på EU-nivå. Det redovisar statens bruttoskuld, utan hänsyn till tillgångar. För att ta fram det måttet adderas finansiella förvaltningstillgångar till måttet B.

Riksgälden redovisar även "Statens skulder inklusive vidareutlåning och förvaltningstillgångar" (under D ovan). Här inkluderas inte bara förvaltningstillgångar utan även vissa andra finansiella tillgångar, nämligen vidareutlåning till Riksbanken och utländska stater. Detta mått används i styrningen av statsskulden enligt riktlinjer som beslutas av regeringen och i vår interna riskhantering. Vidareutlåning utgör en fordran för staten, men är inte på samma sätt som tillgångar i penningmarknaden tillgänglig för betalning av statens utgifter.

Skulder redovisas med positivt tecken samt tillgångar med negativt. Förändring avser förändring av det nominella beloppet från föregående månad. Redovisningen är baserad på affärsdag.

KAPITALMARKNAD

Statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB 1051 3.75% 12 Aug 17	2006-09-15	0,9	0,9	0	65 525 775 000
SGB 1052 4.25% 12 Mar 19	2007-11-21	2,4	2,3	2 000 000 000	96 050 120 000
SGB 1047 5% 1 Dec 20	2004-01-28	4,2	3,8	0	95 053 780 000
SGB 1054 3.5% 1 Jun 22	2011-02-09	5,7	5,2	0	93 130 500 000
SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	2012-10-22	7,1	6,7	1 500 000 000	77 477 000 000
SGB 1058 2.5% 12 May 25	2014-02-03	8,6	7,9	0	65 372 000 000
SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	2015-05-22	10,1	9,6	3 500 000 000	60 647 000 000
SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	2012-03-20	15,7	13,6	0	12 500 000 000
SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	2009-03-30	22,5	17,1	0	45 250 450 000
		6,8	6,3	7 000 000 000	611 006 625 000

Reala statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Inflationskompensation	Inkl. inflationskomp.	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB IL 3107 0.5% 1 Jun 17	2010-09-23	0,7	0,7	677 620 061	15 635 620 061	0	14 958 000 000
SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19	2015-02-09	2,7	2,7	220 847 732	22 309 847 732	1 215 000 000	22 089 000 000
SGB IL 3102 4% 1 Dec 20	1996-06-03	4,2	3,8	10 373 840 921	45 887 890 921	1 050 000 000	35 514 050 000
SGB IL 3108 0.25% 1 Jun 22	2011-09-15	5,7	5,6	515 458 317	30 146 458 317	400 000 000	29 631 000 000
SGB IL 3109 1% 1 Jun 25	2014-02-11	8,7	8,4	180 653 246	22 930 653 246	440 000 000	22 750 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	2016-02-15	9,7	9,6	115 049 769	12 372 049 769	100 000 000	12 257 000 000
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	1998-06-23	12,2	10,4	876 316	3 876 316	0	3 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	1999-04-19	12,2	10,4	7 228 772 340	37 843 062 340	-90 000 000	30 614 290 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	2015-04-30	15,7	15,5	138 337 232	7 369 337 232	-260 000 000	7 231 000 000
		6,8	6,7	19 451 455 936	194 498 795 936	2 855 000 000	175 047 340 000

Publika obligationer i utländsk valuta

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs	Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB USD 0.625% 19 Sep 16	2014-09-19	-	-	0	0	-14 223 000 000	0
EUB USD 1% 15 Nov 16	2013-08-30	0,1	0,1	3 000 000 000	25 694 100 000	0	19 541 100 000
EUB USD 0.75% 12 Apr 17	2014-03-25	0,5	0,5	2 000 000 000	17 129 400 000	0	12 660 600 000
EUB USD 0.875% 15 Aug 17	2014-05-28	0,9	0,9	1 500 000 000	12 847 050 000	0	9 863 025 000
EUB USD 1% 13 Nov 17	2014-11-13	1,1	1,1	3 000 000 000	25 694 100 000	0	22 146 600 000
EUB USD 0.875% 23 Jan 18	2015-01-23	1,3	1,3	2 500 000 000	21 411 750 000	0	20 280 125 000
EUB USD 1% 27 Feb 18	2013-02-27	1,4	1,4	3 000 000 000	25 694 100 000	0	18 877 500 000
EUB USD 1.125% 15 May 18	2015-05-13	1,6	1,6	2 250 000 000	19 270 575 000	0	18 447 975 000
EUB USD 1% 5 Oct 18	2015-10-05	2,0	2,0	1 000 000 000	8 564 700 000	0	8 420 700 000
EUB USD 1,125% 15 Mar 19	2016-03-15	2,5	2,4	2 000 000 000	17 129 400 000	0	16 938 600 000
EUB USD 1,625% 24 Mar 20	2015-03-24	3,5	3,4	2 000 000 000	17 129 400 000	0	17 267 112 500
EUB USD 1,25% 8 Sep 21	2016-09-08	4,9	4,8	2 000 000 000	17 129 400 000	0	17 080 800 000
EUB EUR 0,25% 27 Nov 16	2013-11-27	0,2	0,1	1 000 000 000	9 626 294 570	0	8 933 918 540
EUB EUR 0.13% 25 Jun 17	2014-06-25	0,7	0,7	500 000 000	4 813 147 285	0	4 500 720 290
EUB EUR 0.875% 31 Jan 18	2013-01-31	1,3	1,3	4 000 000 000	38 505 178 280	0	34 763 460 000
EUB EUR 0.75% 2 May 19	2014-05-02	2,6	2,6	2 250 000 000	21 659 162 783	0	20 402 744 918
EUB EUR 0.05% 12 Feb 20	2015-02-12	3,4	3,4	1 500 000 000	14 439 441 855	0	14 156 448 840
ESB EUR 9.405% 28 Dec 26	1996-04-09	10,2	7,7	60 101 210	578 551 951	0	534 099 996
		1,7	1,7		297 315 751 724	-14 223 000 000	264 815 530 084

Privatplaceringar i utländsk valuta m.m.

Instrument	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs inkl. infl. kompensation	Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB USD 0.75% 16 Mar 17	0,5	0,5	1 500 000 000	12 847 050 000	0	12 612 250 000
Privatplaceringar, utländsk valuta	0,5	0,5		12 847 050 000	0	12 612 250 000
	0,5	0,5		12 847 050 000	0	12 612 250 000

Summa: Kapitalmarknad

-4 368 000 000 1 063 481 745 084

PENNINGMARKNAD

Statsskuldväxlar

Statsskuldväxel	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
STB 21 Sep 16	2016-03-11	-	-	-65 000 000 000	0
STB 19 Oct 16	2016-07-01	0,1	0,0	0	15 000 000 000
STB 16 Nov 16	2016-08-05	0,1	0,1	0	22 500 000 000
STB 21 Dec 16	2016-06-03	0,2	0,2	5 000 000 000	32 500 000 000
STB 15 Mar 17	2016-09-02	0,5	0,4	15 000 000 000	25 000 000 000
		0,2	0,2	-45 000 000 000	95 000 000 000

Commercial paper

Instrument	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs	Förändring	Nominellt belopp, kr
	-	-		0	0	0

Likviditetsförvaltningsinstrument

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Bankkonton, kronor	136 131	272 921	136 131
Bankkonton, utländsk valuta	4 435 939	-403 600 118	-80 288 461
Banklån mm	8 104 000 000	-15 958 000 000	8 104 000 000
Banklån, konton mm	8 108 572 070	-16 361 327 197	8 023 847 670
Repor, Reala statsobligationer	173 122 772	-380 272 185	-1 281 996 944
Repor, Statsobligationer	32 780 485 751	-3 167 215 344	32 780 485 751
Repor, Statsskuldväxlar	298 079 711	-8 679 310 173	-7 671 907 010
Repor, svenska statspapper	33 251 688 234	-12 226 797 702	23 826 581 797
Bostadsobligationer, innehav	0	5 200 000 000	0
Riksbankscertifikat, innehav	0	34 500 000 000	-15 500 000 000
Värdepappersinnehav	0	39 700 000 000	-15 500 000 000
	41 360 260 304	11 111 875 101	16 350 429 467

Säkerheter

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Credit Support Annex till ISDA, SEK	6 405 400 000	-925 000 000	6 405 400 000
Credit Support Annex till ISDA, utländsk valuta	7 923 403 061	-1 465 510 537	7 923 403 061
Marginalsäkerheter, Futures	0	13 149 490	-133 941 420
Säkerheter under central motpartsclearing	6 844 359 450	-170 092 571	4 851 183 686
	21 173 162 511	-2 547 453 617	19 046 045 326

Summa: Penningmarknad

-36 435 578 516 130 396 474 793

PRIVATMARKNAD

Premieobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utgivet	Behållet	Förändring	Nominellt belopp, kr
SLB 2012:1 0.8% 19 Apr 17	2012-04-30	0,6	0,5	2 000 000 000	-61 735 000	0	1 938 265 000
SLB 2015:1 0.1% 19 Apr 17	2015-05-13	0,6	0,5	1 300 000 000	-82 975 000	0	1 217 025 000
SLB 2015:2 0.1% 1 Nov 17	2015-11-27	1,1	1,1	1 500 000 000	-95 100 000	0	1 404 900 000
SLB 2016:1 0.1% 16 Maj 18	2016-05-09	1,6	1,6	1 400 000 000	-5 485 000	0	1 394 515 000
SLB 2013:1 0.7% 16 Maj 18	2013-05-22	1,6	1,6	2 100 000 000	-67 040 000	0	2 032 960 000
SLB 2013:2 1.0% 13 Nov 18	2013-11-12	2,1	2,1	2 100 000 000	-29 175 000	0	2 070 825 000
SLB 2014:1 0.8% 7 Maj 19	2014-04-30	2,6	2,6	2 100 000 000	-63 635 000	0	2 036 365 000
SLB 2014:2 0.6% 2 Dec 21	2014-11-26	5,2	5,1	2 900 000 000	-10 515 000	0	2 889 485 000
		2,2	2,2	15 400 000 000	-415 660 000	0	14 984 340 000

Riksgäldsspar

Kontoform	Förändring	Nominellt belopp, kr
Riksgäldsspar, nominellt	-9 453 020	241 368 950
Riksgäldsspar, reallt	-2 995 509	118 725 673
	-12 448 529	360 094 623

Summa: Privatmarknad

-12 448 529 15 344 434 623

ALLA MARKNADER INKL. FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

Förändring Nominellt belopp

Summa nominella belopp. Under A på sidan 1.

-40 816 027 045 1 209 222 654 499

APPENDIX

Olika skuldslag, inklusive vidareutlåning och förvaltningsstillgångar

Skuldslag	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs och uppräkningsbelopp	Löptid	Duration	Andel
Nominell kronskuld	667 110 195 265	666 860 195 265	5,63	5,02	65,8
Real kronskuld	175 166 065 673	194 617 521 609	6,78	6,68	19,2
Valutaskuld	148 013 725 395	151 244 550 216	1,65	0,17	14,9
	990 289 986 333	1 012 722 267 090	4,77	4,74	100,0

Nominell kronskuld, inklusive förvaltningsstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr
Statsobligationer	611 006 625 000
Statsskuldväxlar	95 000 000 000
Valutaterminer, SEK	26 340 461 130
Likviditetsförvaltning	16 430 717 928
Privatmarknad	15 225 708 950
Säkerheter	11 256 682 258
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	-108 150 000 000
	667 110 195 265

Real kronskuld

Instrument	Nominellt belopp, kr	Inflationskompensation, kr	Real kronskuld, kr
Reala statsobligationer	175 047 340 000	19 451 455 936	194 498 795 936
Riksgäldsspar, reall	118 725 673	0	118 725 673
	175 166 065 673	19 451 455 936	194 617 521 609

Valutaskuld, inkl. vidareutlåning och penningmarknadstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr	Valutakurseffekter, kr	Valutaskuld, kr
Publika obligationer, utländsk valuta	264 281 430 088	32 455 769 685	296 737 199 773
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	108 150 000 000	3 842 166 302	111 992 166 302
Övriga valutaskulder	13 146 349 996	608 156 602	13 754 506 598
Säkerheter	7 789 363 068	-0	7 789 363 068
Likviditetsförvaltning	-80 288 461	0	-80 288 461
Valutaterminer, SEK	-26 340 461 130	-299 624 956	-26 640 086 086
Vidareutlåning	-218 932 668 166	-33 375 642 812	-252 308 310 977
	148 013 725 395	3 230 824 821	151 244 550 216

Valutaskuld exklusive vidareutlåning	366 946 393 561	36 606 467 632	403 552 861 193
--------------------------------------	-----------------	----------------	-----------------

Swappar, nominellt nettobelopp med fast ränta i kronor

Förfalloår	Ränteswappar i kronor, kr	Ränteswappar mellan kronor och utländska valutor, kr	Ränteswappar totalt, kr
2016	3 250 000 000	8 750 000 000	12 000 000 000
2017	15 750 000 000	23 050 000 000	38 800 000 000
2018	20 550 000 000	7 750 000 000	28 300 000 000
2019	14 600 000 000	26 300 000 000	40 900 000 000
2020	18 950 000 000	10 000 000 000	28 950 000 000
2021	25 250 000 000	11 250 000 000	36 500 000 000
2022	16 250 000 000	12 500 000 000	28 750 000 000
2023	6 850 000 000	5 000 000 000	11 850 000 000
2024	4 750 000 000	2 500 000 000	7 250 000 000
2025	3 300 000 000	0	3 300 000 000
2026	1 550 000 000	0	1 550 000 000
	131 050 000 000	107 100 000 000	238 150 000 000

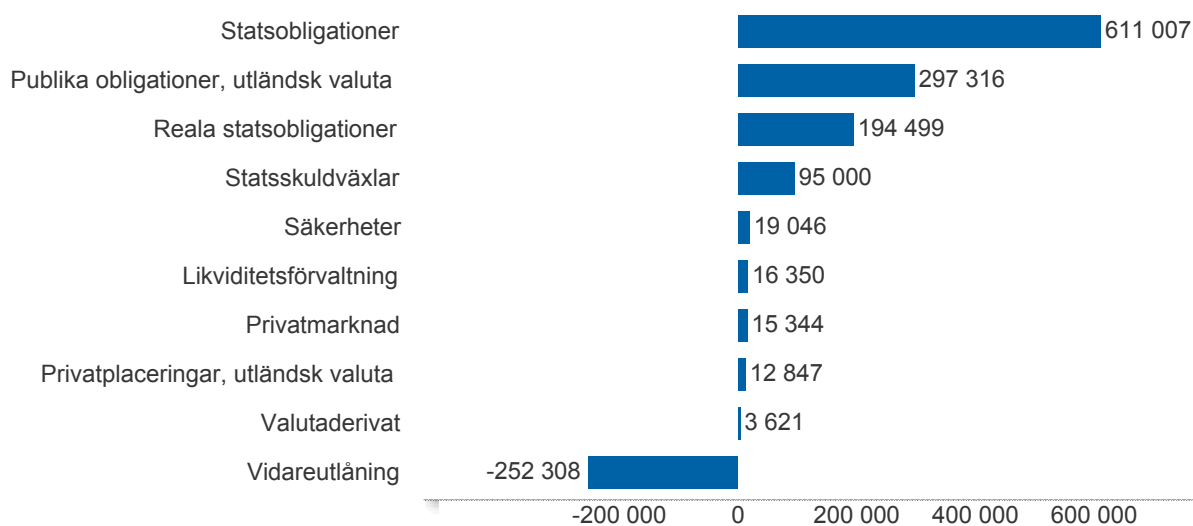
Skulder och tillgångar i likviditetsförvaltning och betalning av säkerheter

Instrument	Nominellt belopp	Bruttoskuld	Tillgångar	Aktuell valutakurs
Banklån, konton mm	8 023 847 670	8 108 572 070	-84 724 400	-84 724 400
Credit Support Annex till ISDA	14 328 803 061	14 328 803 061	0	0
Marginalsäkerheter, Futures	-133 941 420	0	-133 941 420	-133 941 420
Repot, svenska statspapper	23 826 581 797	33 251 688 234	-9 425 106 437	-9 425 106 437
Säkerheter under central motpartsclearing	4 851 183 686	6 844 359 450	-1 993 175 764	-1 993 175 764
Värdepappersinnehav	-15 500 000 000	0	-15 500 000 000	-15 500 000 000
	35 396 474 793	62 533 422 815	-27 136 948 022	-27 136 948 022

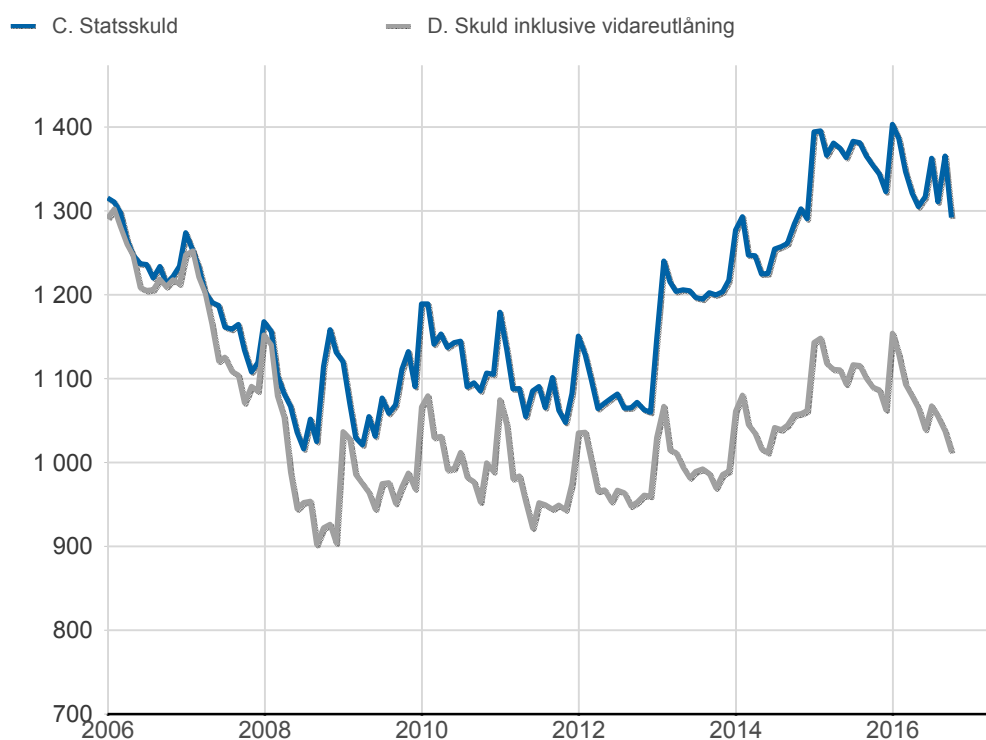
Översikt av statens skuld, mnkr

	A. Nominellt belopp	B. Aktuella valutakurser	Andel %	Löptid år	Duration år	C. Stats-skuld	D. Inkl. vidareutlåning	Andel %	D. Marknads-värde
Statsobligationer	611 007	611 007	48,3	6,8	6,3	611 007	611 007	60,3	734 345
Reala statsobligationer	175 047	194 499	15,4	6,8	6,7	194 499	194 499	19,2	245 359
Publika obligationer, utländsk valuta	264 816	297 316	23,5	1,7	1,7	297 316	297 316	29,4	300 489
Privatplacering, utländsk valuta	12 612	12 847	1,0	0,5	0,5	12 847	12 847	1,3	12 846
Kapitalmarknad	1 063 482	1 115 668	88,2	5,4	5,3	1 115 668	1 115 668	110,2	1 293 039
Statsskuldväxlar	95 000	95 000	7,5	0,2	0,2	95 000	95 000	9,4	95 171
Säkerheter	19 046	19 046	1,5	0,0	0,0	21 173	19 046	1,9	19 164
Likviditetsförvaltning	16 350	16 350	1,3	0,0	0,0	41 360	16 350	1,6	16 349
Penningmarknad	130 396	130 396	10,3	0,2	0,2	157 533	130 396	12,9	130 684
Premieobligationer	14 984	14 984	1,2	2,2	2,2	14 984	14 984	1,5	15 387
Riksgäldsspar	360	360	0,0	1,3	1,3	360	360	0,0	363
Privatmarknad	15 344	15 344	1,2	2,2	2,2	15 344	15 344	1,5	15 750
Valutaderivat	0	3 621	0,3	-	37,1	3 621	3 621	0,4	-8 848
Räntederivat	0	0	0,0	-	45,5	0	0	0,0	-14 039
Derivatmarknad	0	3 621	0,3	-	42,2	3 621	3 621	0,4	-22 887
Vidareutlåning	0	0	0,0	-	-	0	-252 308	-24,9	0
	1 209 223	1 265 031	100,0	4,8	4,2	1 292 168	1 012 722	100,0	1 416 587

D. Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mnkr

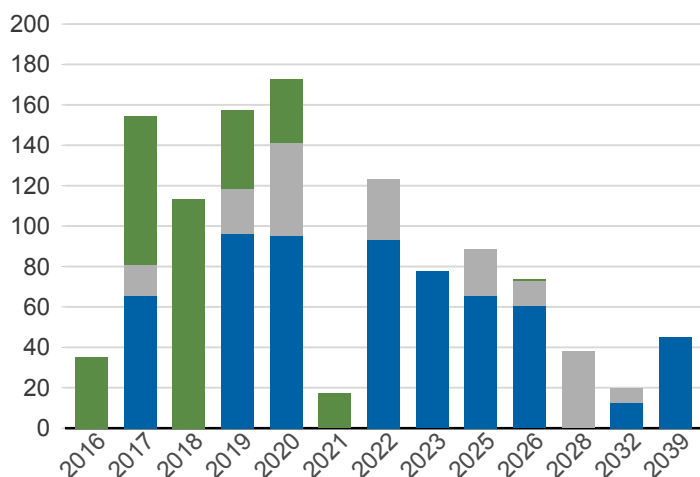


Statsskuld och Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mdkr



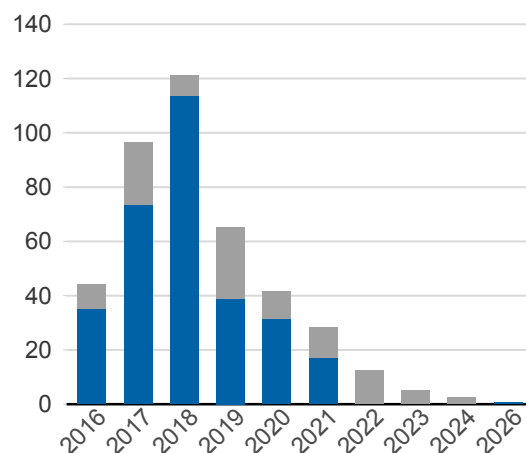
Kapitalmarknadsförfall, uppräknade belopp till aktuella valutakurser, mdkr

Obligationer, utländsk valuta Statsobligationer
 Reala statsobligationer

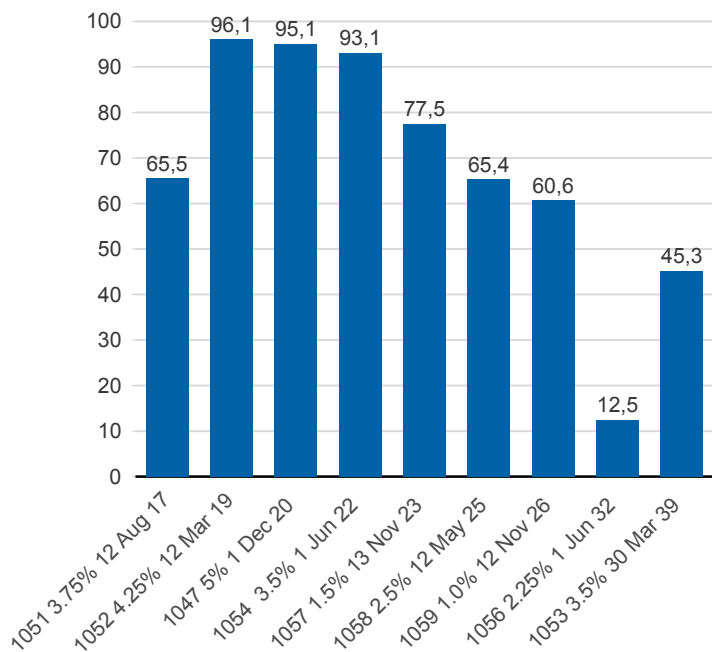


Valutaskuld på kapitalmarknaden inklusive swappar, aktuell valutakurs, mdkr

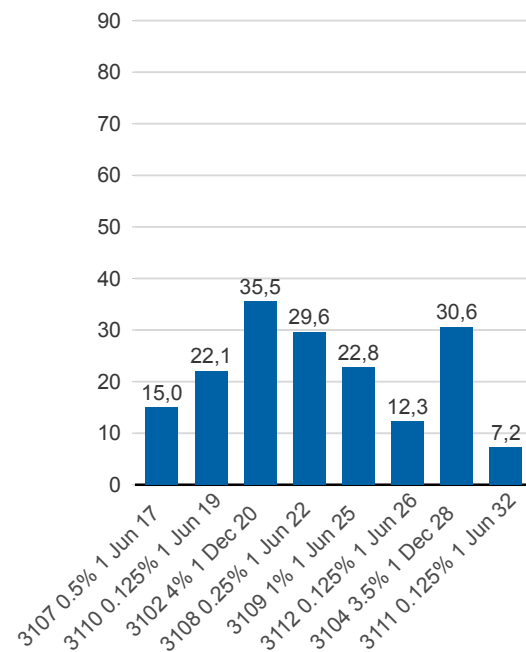
Ränteswappar mellan SEK och utländska valutor
 Obligationer i utländsk valuta



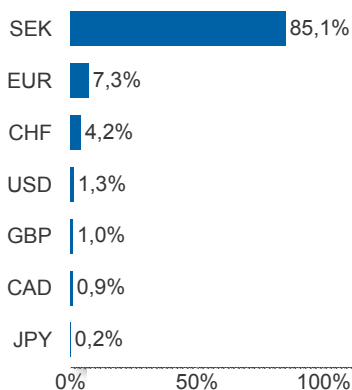
Statsobligationer, nominellt, mdkr



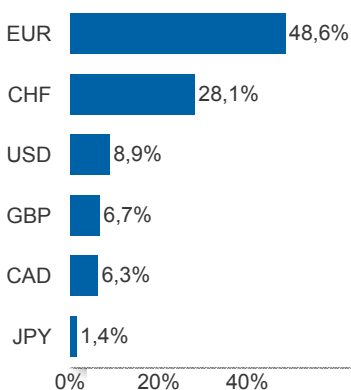
Reala statsobligationer, nominellt, mdkr



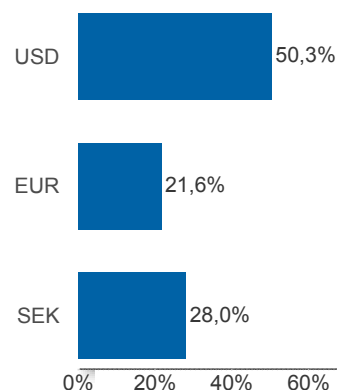
Valutaexponering, skulder och fordringar i vidareutlåningen, netto, %



Valutaexponering i valutaskulden, skulder och fordringar i vidareutlåningen, netto, %

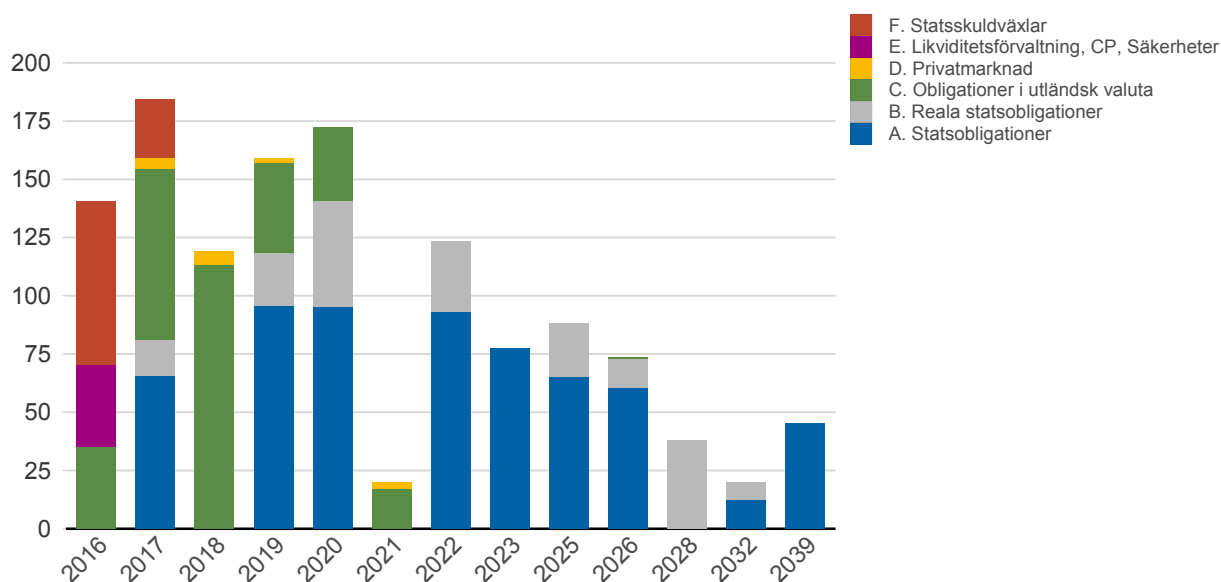


Finansiering av valutaskulden, inklusive finansiering av vidareutlåningen, brutto, %



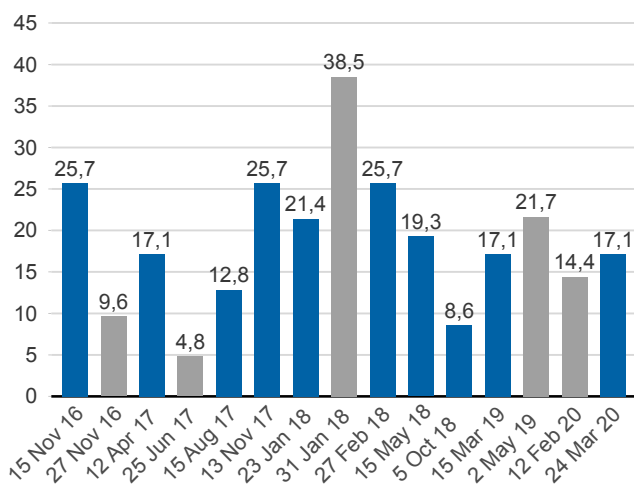
Anm: Finansieringen i SEK avser kronskuld som i kombination med swappar ger exponering i utländsk valuta.

Förfalloprofil för hela skulden, aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar, mdkr



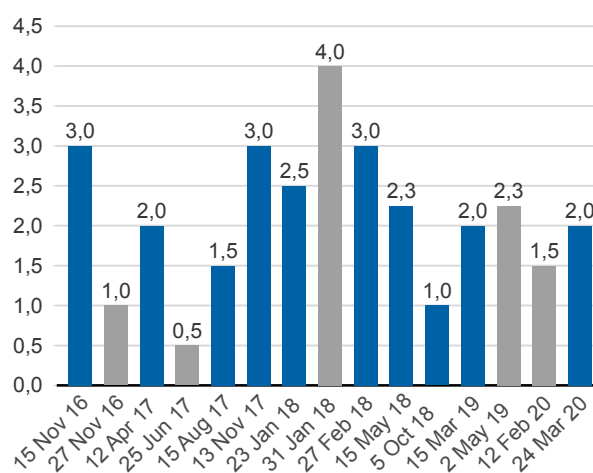
Publ. obligationer i euro och dollar, aktuell valutakurs, mdkr

■ EUR ■ USD



Publ. obligationer i euro och dollar, md i resp. valuta

■ EUR ■ USD



Vidareutlåning

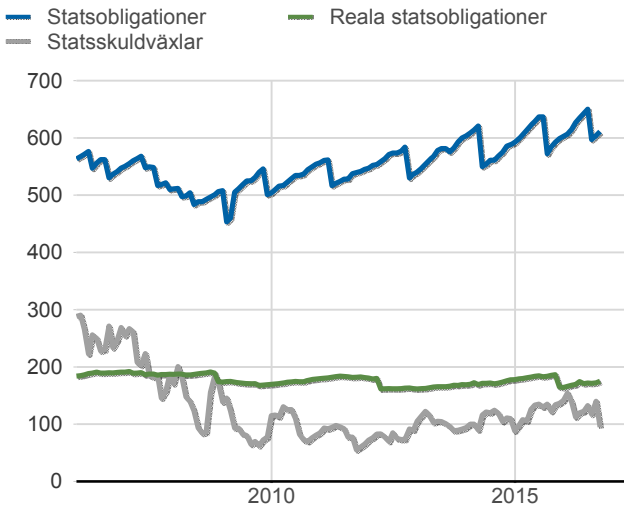
Mottagare	EUR	USD	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs
Vidareutlåning till Irland	600 000 000	0	5 242 515 794	5 775 776 742
Vidareutlåning till Riksbanken, kapitalmarknad	5 500 000 000	22 603 000 000	213 690 152 372	246 532 534 235
	6 100 000 000	22 603 000 000	218 932 668 166	252 308 310 977

Vidareutlåning till Riksbanken, förfall

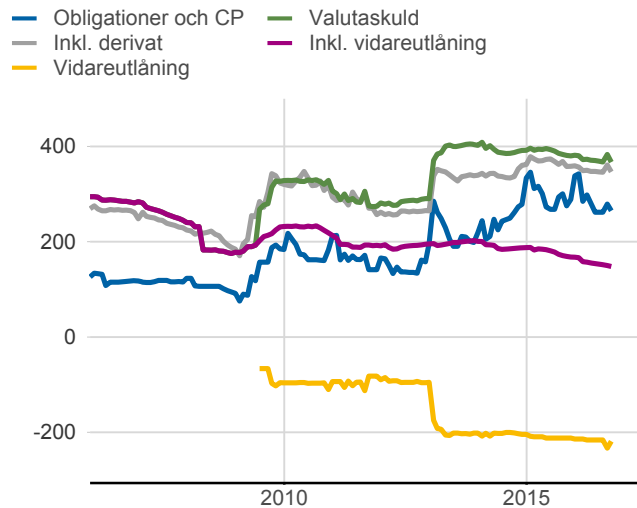
Aktuell valutakurs, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
	0	246 532 534 235	246 532 534 235
Nominellt belopp, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
2016-11-15	0	19 541 100 000	19 541 100 000
2016-11-27	0	8 933 918 532	8 933 918 532
2017-04-12	0	12 660 600 000	12 660 600 000
2017-08-15	0	9 863 025 000	9 863 025 000
2017-11-13	0	22 146 600 000	22 146 600 000
2018-01-23	0	20 280 125 000	20 280 125 000
2018-01-31	0	34 763 460 000	34 763 460 000
2018-02-27	0	18 877 500 000	18 877 500 000
2018-05-15	0	18 447 975 000	18 447 975 000
2019-03-15	0	16 938 600 000	16 938 600 000
2020-02-12	0	14 156 448 840	14 156 448 840
2021-09-08	0	17 080 800 000	17 080 800 000
	0	213 690 152 372	213 690 152 372

Förfalldatum	Dollar	Euro
Nominellt belopp, respektive valuta		
2016-11-15	3 000 000 000	0
2016-11-27	1 353 000 000	0
2017-04-12	2 000 000 000	0
2017-08-15	1 500 000 000	0
2017-11-13	3 000 000 000	0
2018-01-23	2 500 000 000	0
2018-01-31	0	4 000 000 000
2018-02-27	3 000 000 000	0
2018-05-15	2 250 000 000	0
2019-03-15	2 000 000 000	0
2020-02-12	0	1 500 000 000
2021-09-08	2 000 000 000	0
	22 603 000 000	5 500 000 000

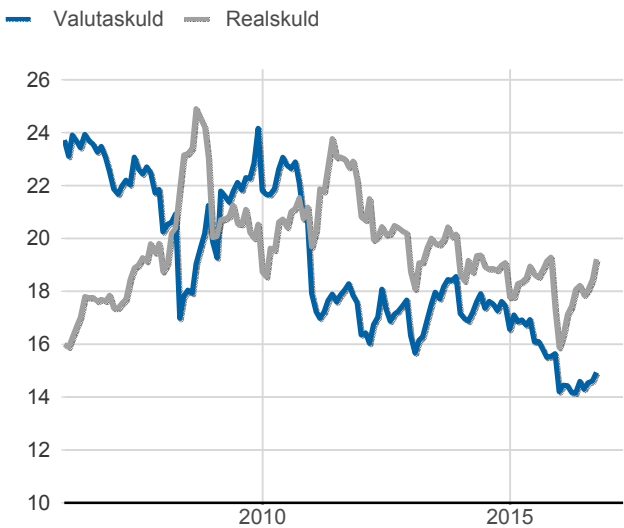
Statsobligationer, reaala statsobligationer och statsskuldväxlar, nominella belopp, mdkr



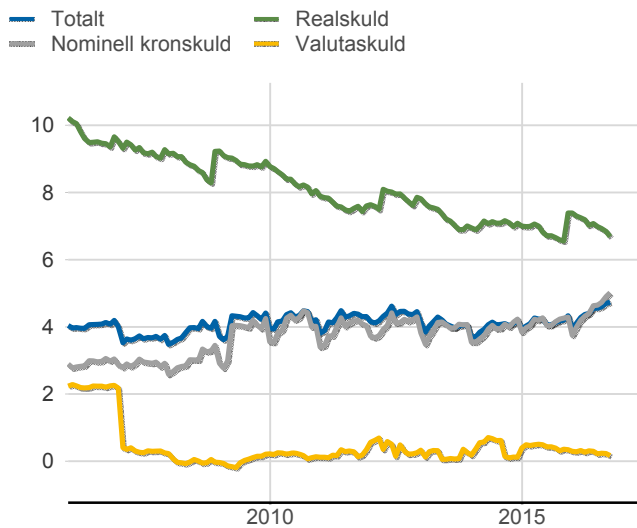
Valutaskuld inkl. vidareutlåning uppdelat på instrument, nominella belopp, mdkr



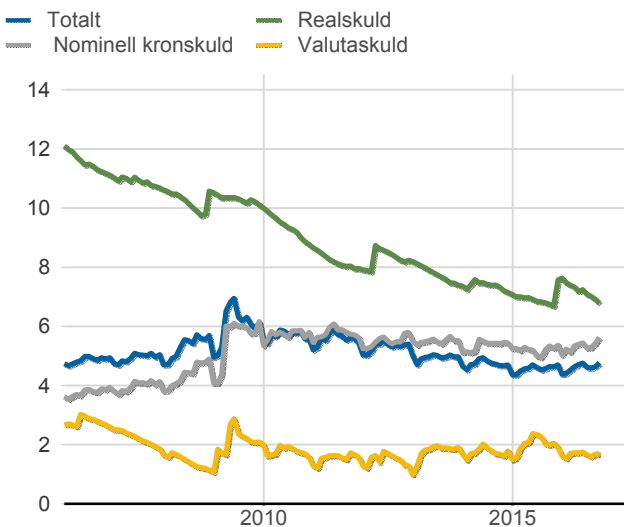
Skuldandelar, inklusive vidareutlåning, procent



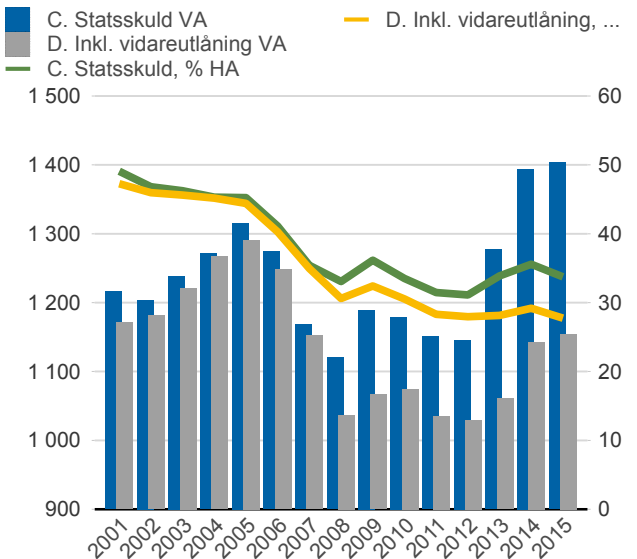
Duration för den totala skulden och respektive skuldslag, inkl. vidareutlåning, år



Återstående löptid till förfall, exklusive vidareutlåning, år



Statsskuld resp. Statens skuld inkl. vidareutlåning, mdkr och procent av BNP



Anm: Återstående löptid till förfall för valutaskulden avser endast obligationer och commercial paper.

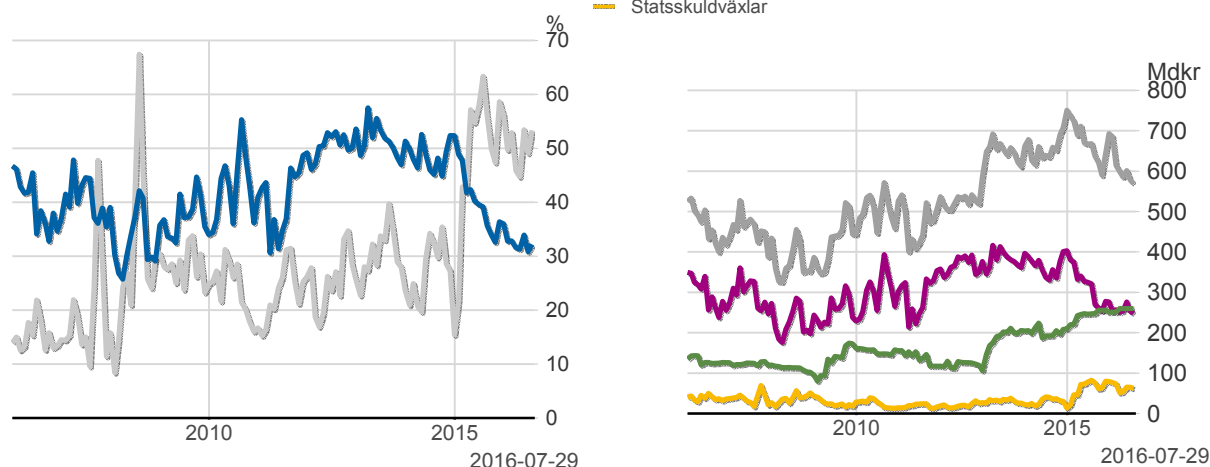
Finansiering av statens skuld, inklusive och exklusive finansiering av vidareutlåning, nominellt belopp, kr

Valuta	Instrument	Nominellt belopp	Procent	Exklusive vidareutlåning	Procent	Vidareutlåning	
Kronor	Statsobligationer	611 006 625 000	50,5	605 764 109 207	61,2	5 242 515 794	
	Reala statsobligationer	175 044 340 000	14,5	175 044 340 000	17,7	0	
	Statsskuldväxlar	95 000 000 000	7,9	95 000 000 000	9,6	0	
	Säkerheter	11 256 682 258	0,9	11 256 682 258	1,1	0	
	Likviditetsförvaltning	16 430 717 928	1,4	16 430 717 928	1,7	0	
	Premieobligationer	14 984 340 000	1,2	14 984 340 000	1,5	0	
	Riksgäldsspar	360 094 623	0,0	360 094 623	0,0	0	
	Övriga kapitalmarknadsskulder	3 000 000	0,0	3 000 000	0,0	0	
			924 085 799 808	76,4	918 843 284 015	92,8	5 242 515 794
Utländsk valuta	Obligationer i utländsk valuta	277 427 780 084	22,9	63 737 627 712	6,4	213 690 152 372	
	Säkerheter	7 789 363 068	0,6	7 789 363 068	0,8	0	
	Likviditetsförvaltning	-80 288 461	-0,0	-80 288 461	-0,0	0	
		285 136 854 691	23,6	71 446 702 319	7,2	213 690 152 372	
		1 209 222 654 499	100,0	990 289 986 333	100,0	218 932 668 166	

Utlandets innehav av statspapper m.m., procent respektive mdkr

— Statsskuldväxlar
— Obligationer, SEK

— Uppskattad summa värdepapper
— Statsobligationer
— Obligationer, utl. valuta, uppskattat
— Statsskuldväxlar



Anm: Uppgifterna för obligationer i utländsk valuta före 2007 och för likviditetsinstrument samt säkerheter är schablonmässigt uppskattade.
Källa: Statistiska centralbyrån och Riksgälden

Statsobligationer, reala statsobligationer och obligationer i utländsk valuta

Instrument	Obligationer	Serie	Valuta	ISIN-nummer	ISIN US 144A	Kupong-ränta	Utgivningsdag	Förfallodag	Ursprunglig löptid	Volym resp. valuta
Statsobligationer	SGB 1047 5% 1 Dec 20	1047	SEK	SE0001149311	-	5	2004-01-28	2020-12-01	16,9	95 053 780 000
	SGB 1051 3.75% 12 Aug 17	1051	SEK	SE0001811399	-	3,75	2006-09-15	2017-08-12	10,9	65 525 775 000
	SGB 1052 4.25% 12 Mar 19	1052	SEK	SE0002241083	-	4,25	2007-11-21	2019-03-12	11,3	96 050 120 000
	SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	1053	SEK	SE0002829192	-	3,5	2009-03-30	2039-03-30	30,0	45 250 450 000
	SGB 1054 3.5% 1 Jun 22	1054	SEK	SE0003784461	-	3,5	2011-02-09	2022-06-01	11,3	93 130 500 000
	SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	1056	SEK	SE0004517290	-	2,25	2012-03-20	2032-06-01	20,2	12 500 000 000
	SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	1057	SEK	SE0004869071	-	1,5	2012-10-22	2023-11-13	11,1	77 477 000 000
	SGB 1058 2.5% 12 May 25	1058	SEK	SE0005676608	-	2,5	2014-02-03	2025-05-12	11,3	65 372 000 000
	SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	1059	SEK	SE0007125927	-	1	2015-05-22	2026-11-12	11,5	60 647 000 000
	Reala statsobligationer	SGB IL 3102 4% 1 Dec 20	3102	SEK	SE0000317943	-	4	1996-06-03	2020-12-01	24,5
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28		3103	SEK	SE0000479453	-	3,5	1998-06-23	2028-12-01	30,5	3 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28		3104	SEK	SE0000556599	-	3,5	1999-04-19	2028-12-01	29,6	30 614 290 000
SGB IL 3107 0.5% 1 Jun 17		3107	SEK	SE0003524669	-	0,5	2010-09-23	2017-06-01	6,7	14 958 000 000
SGB IL 3108 0.25% 1 Jun 22		3108	SEK	SE0004211084	-	0,25	2011-09-15	2022-06-01	10,7	29 631 000 000
SGB IL 3109 1% 1 Jun 25		3109	SEK	SE0005703550	-	1	2014-02-11	2025-06-01	11,3	22 750 000 000
SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19		3110	SEK	SE0006758736	-	0,125	2015-02-09	2019-06-01	4,3	22 089 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32		3111	SEK	SE0007045745	-	0,125	2015-04-30	2032-06-01	17,1	7 231 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26		3112	SEK	SE0008014062	-	0,125	2016-02-15	2026-06-01	10,3	12 257 000 000
Publika obligationer, utländsk valuta		ESB EUR 9.405% 28 Dec 26		EUR	ES0273315038		9,405	1996-04-09	2026-12-28	30,7
	EUB EUR 0.875% 31 Jan 18		EUR	XS0882814386	XS0883993825	0,875	2013-01-31	2018-01-31	5,0	4 000 000 000
	EUB USD 1% 27 Feb 18		USD	XS0895508314	US87020DAF15	1	2013-02-27	2018-02-27	5,0	3 000 000 000
	EUB USD 1% 15 Nov 16		USD	XS0966306465	US87020DAL82	1	2013-08-30	2016-11-15	3,2	3 000 000 000
	EUB EUR 0.25% 27 Nov 16		EUR	XS0997474639		0,25	2013-11-27	2016-11-27	3,0	1 000 000 000
	EUB USD 0.75% 12 Apr 17		USD	XS1048518945	US87020DAM65	0,75	2014-03-25	2017-04-12	3,1	2 000 000 000
	EUB EUR 0.75% 2 May 19		EUR	XS1062909384		0,75	2014-05-02	2019-05-02	5,0	2 250 000 000
	EUB USD 0.875% 15 Aug 17		USD	XS1071827643	US87020DAN49	0,875	2014-05-28	2017-08-15	3,2	1 500 000 000
	EUB EUR 0.13% 25 Jun 17		EUR	XS1081254465		0,13	2014-06-25	2017-06-25	3,0	500 000 000
	EUB USD 1% 13 Nov 17		USD	XS1135379656	US87020DAQ79	1	2014-11-13	2017-11-13	3,0	3 000 000 000
	EUB USD 0.875% 23 Jan 18		USD	XS1171709857	US87020DAR52	0,875	2015-01-23	2018-01-23	3,0	2 500 000 000
	EUB EUR 0.05% 12 Feb 20		EUR	XS1189262345	XS1189262428	0,05	2015-02-12	2020-02-12	5,0	1 500 000 000
	EUB USD 1,625% 24 Mar 20		USD	XS1207317428	US87020DAT19	1,625	2015-03-24	2020-03-24	5,0	2 000 000 000
	EUB USD 1.125% 15 May 18		USD	XS1231271294	US87020DAU81	1,125	2015-05-13	2018-05-15	3,0	2 250 000 000
	EUB USD 1% 5 Oct 18		USD	XS1301030810	US87020DAV64	1	2015-10-05	2018-10-05	3,0	1 000 000 000
	EUB USD 1,125% 15 Mar 19		USD	XS1379422675		1,125	2016-03-15	2019-03-15	3,0	2 000 000 000
	EUB USD 1,25% 8 Sep 21		USD	XS1485745886		1,25	2016-09-08	2021-09-08	5,0	2 000 000 000
Privatplaceringar, ...	EUB USD 0.75% 16 Mar 17		USD	XS1202015902	US87020DAS36	0,75	2015-03-16	2017-03-16	2,0	1 500 000 000

SKULDANDELAR OCH LÖPTIDER SOM DE MÄTS I STYRNINGEN AV FÖRVALTNINGEN

Regeringen beslutar om riktvärden för statsskuldens löptid och fördelningen mellan skuldslagen Nominell kronskuld, Real kronskuld och Valutaskuld.

Det skuldmått som används vid riskstyrningen är statens uppräknade skuldbelopp till aktuell valutakurs inklusive fordringar i vidareutlåning och förvaltningstillgångar. Positioner som tas i derivat för att aktivt ändra exponeringen i skulden ingår inte i beräkningarna. Derivattransaktioner som påverkar fördelningen mellan skuldslagen ingår däremot.

Löptiden mäts med duration (Macaulay). Statsobligationer med löptid längre än tolv år exkluderas vid durationsberäkningen.

Tabellen visar statsskulden respektive det skuldmått som används i riskstyrningen per den sista i månaden samt månadsgenomsnitt för skuldandelar och duration för de bägge mätten.

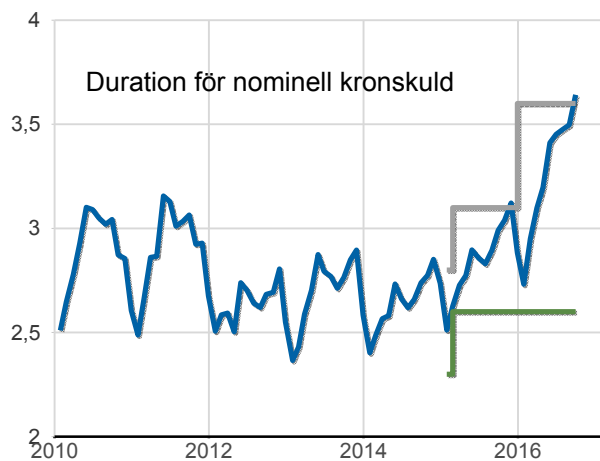
Andelar och löptid (duration) i Riksgäldens riskstyrning

	Statsskulden	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt	Skuldmått riskstyrning	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt
Nominell kronskuld	693 778 378 894	54,7	5,06	666 860 195 265	65,7	3,64
Real kronskuld	194 617 521 609	14,5	6,73	194 617 521 609	19,2	6,73
Valutaskuld	403 771 625 586	30,8	0,19	151 252 458 155	15,0	0,13
	1 292 167 526 089	100,0	4,78	1 012 730 175 029	100,0	3,85

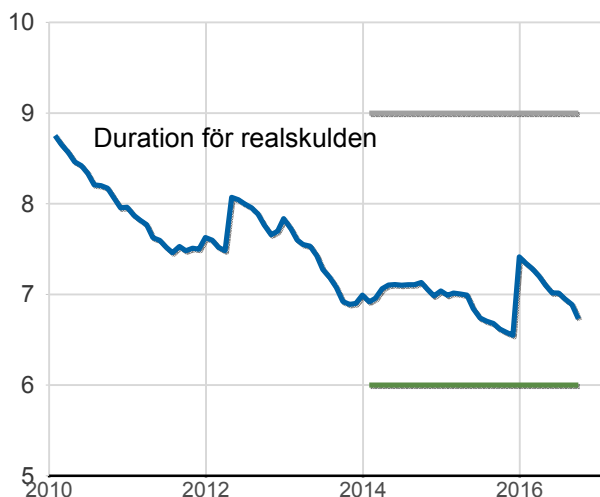
Löptid (duration), år, månadsgenomsnitt

Riktvärdena för löptiderna (duration) är fr.o.m. 2016:
Nominell kronskuld kortare än 12 år, inom intervallet: 2,6-3,6 år
Real kronskuld, inom intervallet: 6-9 år
Valutaskuld: 0-1 år

— Nominell kronskuld, år
— Övre riktvärdet, år
— Undre riktvärdet, år



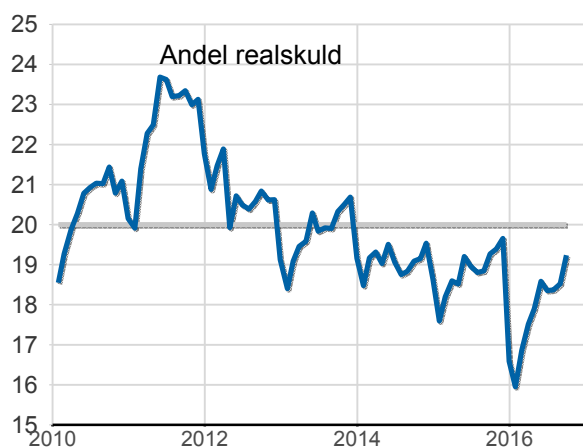
— Övre riktvärdet, år
— Undre riktvärdet, år
— Realskuld, år



Skuldandelar, %, månadsgenomsnitt

Riktvärdena för skuldandelarna är fr.o.m. 2016:
Real kronskuld: 20 %
Valutaskuld: Max. 30 mdkr lägre skuld i USD och JPY än föregående år exkl. valutakursförändringar

— Riktvärde för realskulden, %
— Realskuld, %



— Valutaskuld till ursprunglig valutakurs, mdkr
— Valutaskuld till aktuell valutakurs, mdkr
— Valutaexponering i JPY 2015, mdkr fast valutakurs HA
— Valutaexponering i JPY och USD 2016, mdkr fast valutakurs HA

