

Sveriges statsskuld

29 juli 2022

STATSSKULD

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
A. Nominellt belopp, inkl. förvaltningstillgångar	-11 987 676 999	1 014 583 371 317
Upplupen inflationskompensation (uppräkningsbelopp)	1 934 376 491	32 597 358 118
Valutakurseffekter	-4 639 038 402	13 833 227 787
B. Nominellt uppräknat belopp till aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar	-14 692 338 909	1 061 013 957 223
Förvaltningstillgångar, aktuell valutakurs	-149 844 959	13 692 852 628
Officiellt mått på statens bruttoskuld:		
C. STATSSKULD	-14 842 183 868	1 074 706 809 850

STATENS SKULD INKL. VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
Vidareutlåning	1 616 459 000	-97 660 145 000
Förvaltningstillgångar	149 844 959	-13 692 852 628
D. Statens skuld inklusive vidareutlåning och förvaltningstillgångar	-13 075 879 909	963 353 812 223

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. Notera dock att utgivnings- och förfallodag avser likviddag.

KAPITALMARKNAD

Statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration		Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	2012-10-22	1,3	1,3		0	103 135 000 000
SGB 1058 2.5% 12 May 25	2014-02-03	2,8	2,7		0	77 626 000 000
SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	2015-05-22	4,3	4,2		0	83 914 000 000
SGB 1060 0.75% 12 May 28	2017-01-27	5,8	5,7		0	62 513 000 000
SGB 1061 0.75% 12 Nov 29	2018-06-01	7,3	7,1		0	66 339 000 000
SGB 1062 0.125% 12 May 31	2020-03-27	8,8	8,7		0	52 140 000 000
SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	2012-03-20	9,8	8,9		0	46 814 000 000
SGB 1065 1.75% 11 Nov 33	2022-05-06	11,3	10,2		0	14 500 000 000
SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	2009-03-30	16,7	13,3		0	43 213 450 000
SGB 1063 0.5% 24 Nov 45	2020-11-24	23,3	21,8		0	17 472 000 000
SGB 1064 1,375% 23 Jun 71	2021-06-23	48,9	33,8		0	10 000 000 000
		7,4	6,6		0	577 666 450 000

Reala statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Inflationskompensation	Inkl. inflationskomp.	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB IL 3109 1.0% 1 Jun 25	2014-02-11	2,8	2,8	5 794 427 190	40 947 427 190	0	35 153 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	2016-02-15	3,8	3,8	5 271 220 966	36 929 220 966	0	31 658 000 000
SGB IL 3113 0.125% 1 Dec 27	2017-02-06	5,3	5,3	3 593 104 703	27 459 104 703	0	23 866 000 000
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	1998-06-26	6,3	5,8	493 231	1 493 231	0	1 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	1999-04-22	6,3	5,8	11 933 146 079	39 779 436 079	0	27 846 290 000
SGB IL 3114 0.125% 1 Jun 30	2020-02-10	7,8	7,8	1 665 488 423	20 571 488 423	0	18 906 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	2015-04-30	9,8	9,8	4 009 261 121	26 562 761 121	0	22 553 500 000
SGB IL 3115 0.125% 1 Jun 39	2021-09-06	16,9	16,7	330 216 405	4 898 716 405	0	4 568 500 000
		5,9	5,9	32 597 358 118	197 149 648 118	0	164 552 290 000

Gröna obligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration		Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB G SEK 0.125% 9 Sep 30	2020-09-09	8,1	8,1		0	20 000 000 000
		8,1	8,1		0	20 000 000 000

Publika obligationer i utländsk valuta

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs	Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB USD 0.125% 14 Oct 22	2020-10-14	0,2	0,2	2 500 000 000	25 492 875 000	0	22 277 000 000
EUB USD 2.375% 15 Feb 23	2018-01-11	0,6	0,5	3 000 000 000	30 591 450 000	0	24 396 900 000
EUB EUR 0.125% 24 Apr 23	2018-01-24	0,7	0,7	4 000 000 000	41 575 820 000	0	39 302 711 760
ESB EUR 9.405% 28 Dec 26	1996-04-09	4,4	3,7	33 205 918	345 140 814	0	295 090 240
		0,6	0,5		98 005 285 814	0	86 271 702 000

Privatplaceringar i utländsk valuta m.m.

Instrument	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs inkl. infl. kompensation	Förändring	Nominellt belopp, kr

Summa: Kapitalmarknad

0 848 490 442 000

PENNINGMARKNAD

Statsskuldväxlar

Statsskuldväxel	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
STB 20 Jul 22	2022-04-01	-	-	-15 000 000 000	0
STB 17 Aug 22	2022-05-13	0,1	0,0	0	10 000 000 000
STB 21 Sep 22	2021-09-03	0,1	0,1	0	22 500 000 000
STB 19 Oct 22	2022-07-08	0,2	0,2	10 000 000 000	10 000 000 000
STB 21 Dec 22	2021-12-10	0,4	0,4	0	12 483 000 000
STB 15 Mar 23	2022-03-04	0,6	0,6	0	5 000 000 000
		0,2	0,2	-5 000 000 000	59 983 000 000

Likviditetsförvaltningsinstrument

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Bankkonton, utländsk valuta	94 828 890	-147 111 669	82 279 338
Banklån mm	36 221 000 000	-26 002 000 000	36 221 000 000
Banklån, konton mm	36 315 828 890	-26 149 111 669	36 303 279 338
Commercial paper, utländsk valuta	18 343 164 500	3 856 781 500	18 343 164 500
Commercial paper, utländsk valuta	18 343 164 500	3 856 781 500	18 343 164 500
Repor, Reala statsobligationer	1 347 738 495	-150 522 800	1 181 534 049
Repor, Statsobligationer	59 953 286 208	13 422 999 564	59 953 286 208
Repor, Statsskuldväxlar	3 104 395 901	-518 886 487	-7 686 530 949
Repor, svenska statspapper	64 405 420 604	12 753 590 277	53 448 289 308
	119 064 413 994	-9 538 739 892	108 094 733 146

Säkerheter

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Credit Support Annex till ISDA, SEK	84 900 000	1 531 800 000	-120 400 000
Credit Support Annex till ISDA, utländsk valuta	653 467 951	644 382 398	-541 836 874
Marginalsäkerheter, Futures	0	16 326 306	-55 837 048
Säkerheter under central motpartsclearing	0	358 554 188	-1 266 729 907
	738 367 951	2 551 062 893	-1 984 803 829

Summa: Penningmarknad

-11 987 676 999 166 092 929 317

ALLA MARKNADER INKL. FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

Förändring Nominellt belopp

Summa nominella belopp. Under A på sidan 1.

-11 987 676 999 1 014 583 371 317

APPENDIX

Olika skuldslag, inklusive vidareutlåning och förvaltningstillgångar

Skuldslag	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs och uppräkningsbelopp	Löptid	Duration	Andel
Nominell kronskuld	664 516 213 571	664 516 213 571	5,95	5,84	69,0
Real kronskuld	164 552 290 000	197 149 648 118	5,92	5,85	20,5
Valutaskuld	99 538 255 986	101 687 950 533	0,48	0,14	10,6
	928 606 759 557	963 353 812 223	5,32	5,27	100,0

Nominell kronskuld, inklusive förvaltningstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr
Statsobligationer	577 666 450 000
Likviditetsförvaltning	89 669 289 308
Statsskuldväxlar	59 983 000 000
Gröna obligationer	20 000 000 000
Säkerheter	-1 386 999 489
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	-8 746 750 000
Valutaterminer, SEK	-72 668 776 248
	664 516 213 571

Real kronskuld

Instrument	Nominellt belopp, kr	Inflationskompensation, kr	Real kronskuld, kr
Reala statsobligationer	164 552 290 000	32 597 358 118	197 149 648 118
	164 552 290 000	32 597 358 118	197 149 648 118

Valutaskuld, inkl. vidareutlåning och penningmarknadstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr	Valutakurseffekter, kr	Valutaskuld, kr
Publika obligationer, utländsk valuta	86 271 702 000	11 733 583 814	98 005 285 814
Valutaterminer, SEK	72 668 776 248	-2 027 467 210	70 641 309 038
Likviditetsförvaltning	18 425 443 838	562 351 600	18 987 795 438
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	8 746 750 000	1 926 078 448	10 672 828 448
Övriga valutaskulder	-0	1 638 681 135	1 638 681 135
Säkerheter	-597 804 340	-0	-597 804 340
Vidareutlåning	-85 976 611 760	-11 683 533 240	-97 660 145 000
	99 538 255 986	2 149 694 547	101 687 950 533

Valutaskuld exklusive vidareutlåning 185 514 867 746 13 833 227 787 199 348 095 533

Swappar, nominellt belopp

Förfalloår	Ränteswappar i kronor, kr	Ränteswappar mellan kronor och utländska valutor, kr	Ränteswappar totalt, kr
2022	13 650 000 000	3 500 000 000	17 150 000 000
2023	12 800 000 000	5 000 000 000	17 800 000 000
2024	9 550 000 000	2 500 000 000	12 050 000 000
2025	11 150 000 000	0	11 150 000 000
2026	2 750 000 000	0	2 750 000 000
2027	650 000 000	0	650 000 000
2029	250 000 000	0	250 000 000
2030	100 000 000	0	100 000 000
2032	850 000 000	0	850 000 000
	51 750 000 000	11 000 000 000	62 750 000 000

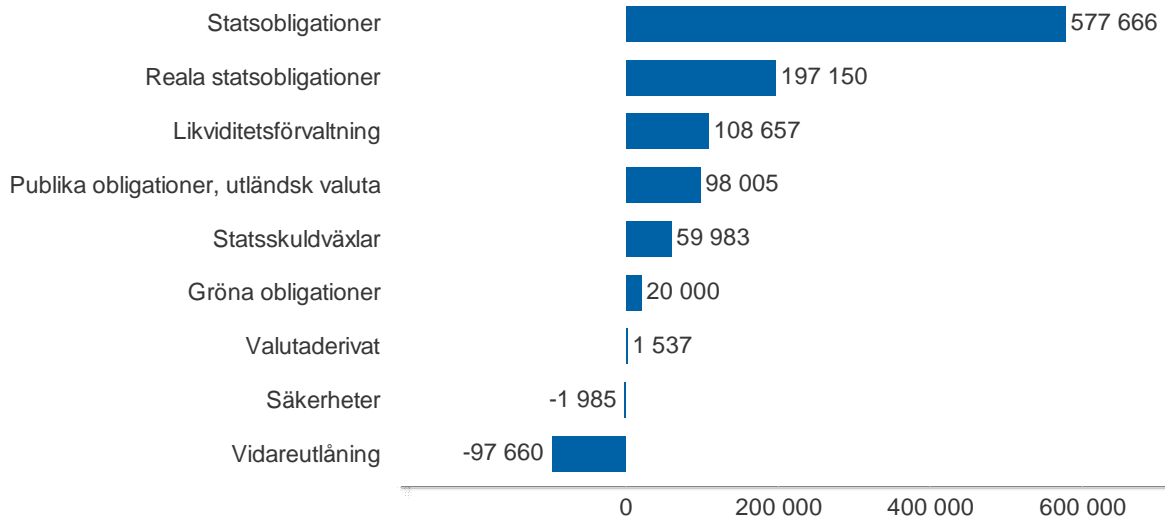
Skulder och tillgångar i likviditetsförvaltning och betalning av säkerheter

Instrument	Nominellt belopp	Bruttoskuld	Tillgångar	Aktuell valutakurs
Banklån, konton mm	36 303 279 338	36 315 828 890	-12 549 552	-12 549 552
Commercial paper, utländsk valuta	18 343 164 500	18 343 164 500	0	0
Credit Support Annex till ISDA	-662 236 874	738 367 951	-1 400 604 825	-1 400 604 825
Marginalsäkerheter, Futures	-55 837 048	0	-55 837 048	-55 837 048
Repor, svenska statspapper	53 448 289 308	64 405 420 604	-10 957 131 296	-10 957 131 296
Säkerheter under central motparts clearing	-1 266 729 907	0	-1 266 729 907	-1 266 729 907
	106 109 929 317	119 802 781 945	-13 692 852 628	-13 692 852 628

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	577 666	577 666	54,4	7,4	6,6	577 666	577 666	60,0	582 567
Reala statsobligationer	164 552	197 150	18,6	5,9	5,9	197 150	197 150	20,5	229 763
Publika obligationer, utländsk valuta	86 272	98 005	9,2	0,6	0,5	98 005	98 005	10,2	98 047
Gröna obligationer	20 000	20 000	1,9	8,1	8,1	20 000	20 000	2,1	18 139
Kapitalmarknad	848 490	892 821	84,1	6,3	5,8	892 821	892 821	92,7	928 517
Statsskuldväxlar	59 983	59 983	5,7	0,2	0,2	59 983	59 983	6,2	59 853
Likviditetsförvaltning	108 095	108 657	10,2	0,0	0,0	119 627	108 657	11,3	108 611
Säkerheter	-1 985	-1 985	-0,2	0,0	0,0	738	-1 985	-0,2	-1 861
Penningmarknad	166 093	166 655	15,7	0,1	0,1	180 348	166 655	17,3	166 604
Räntederivat	0	0				0	0		750
Valutaderivat	-0	1 537	0,1	-	-4,0	1 537	1 537	0,2	1 473
Derivatmarknad	-0	1 537	0,1	-	-38,7	1 537	1 537	0,2	2 223
Vidareutlåning	0	0			-	0	-97 660	-10,1	-97 563
Vidareutlåning	0	0				0	-97 660		-97 563
	1 014 583	1 061 014	100,0	5,3	4,8	1 074 707	963 354	100,0	999 781

D. Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningstillgångar, mnkr

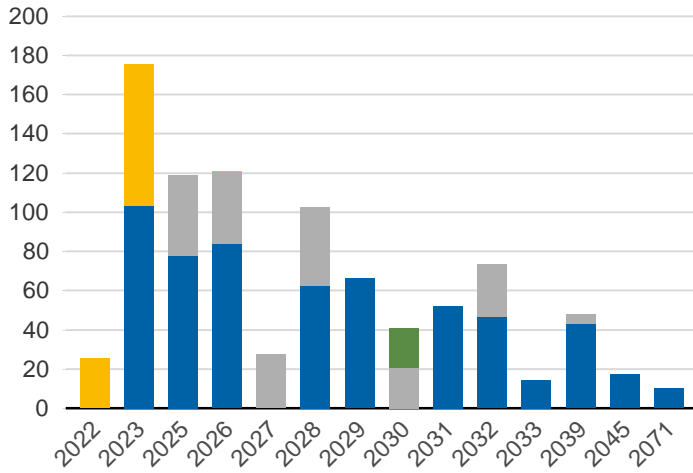


Statsskuld och Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningstillgångar, mnkr



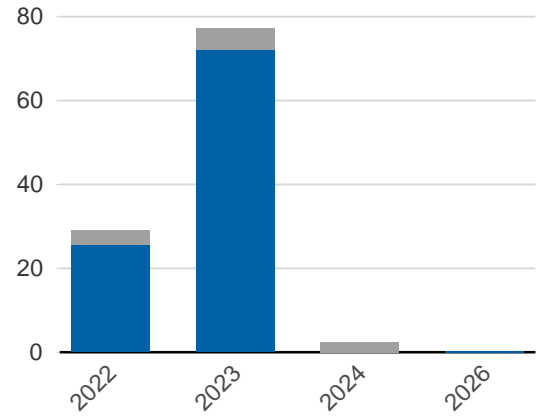
Kapitalmarknadsförfall, uppräknade belopp till aktuella valutakurser, mdkr

■ Statsobligationer
■ Reala statsobligationer
■ Obligationer, utländsk valuta
■ Gröna obligationer

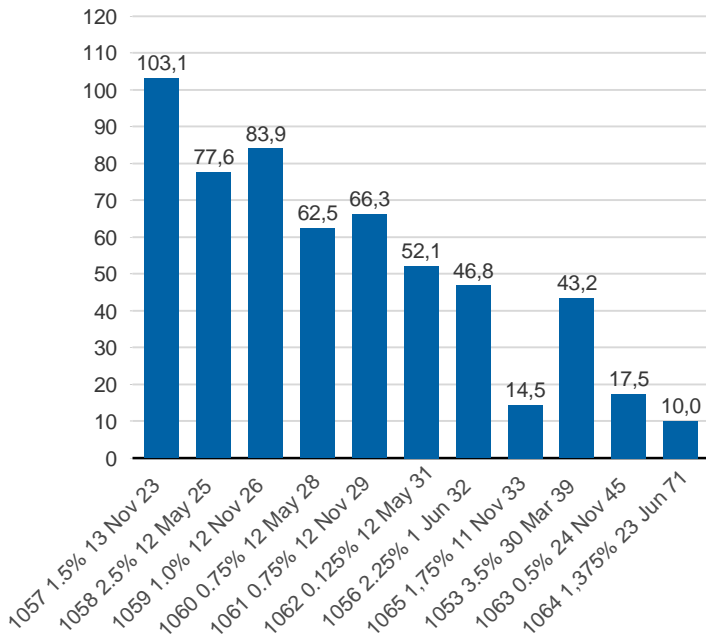


Valutaskuld på kapitalmarknaden inklusive swappar, aktuell valutakurs, mdkr

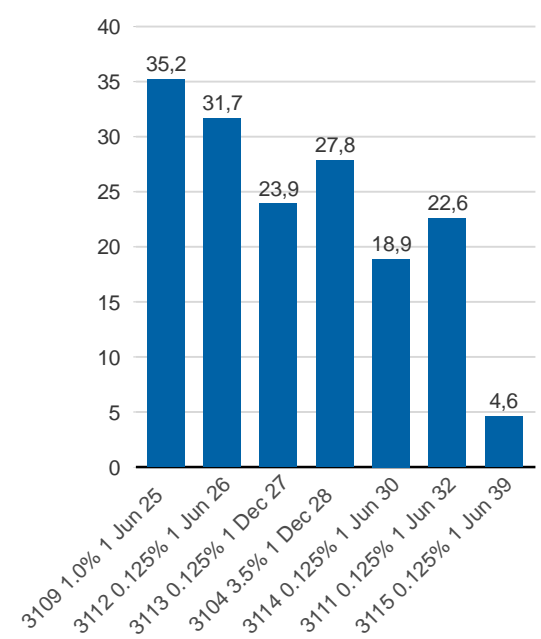
■ Ränteswappar mellan SEK och utländska valutor
■ Obligationer i utländsk valuta



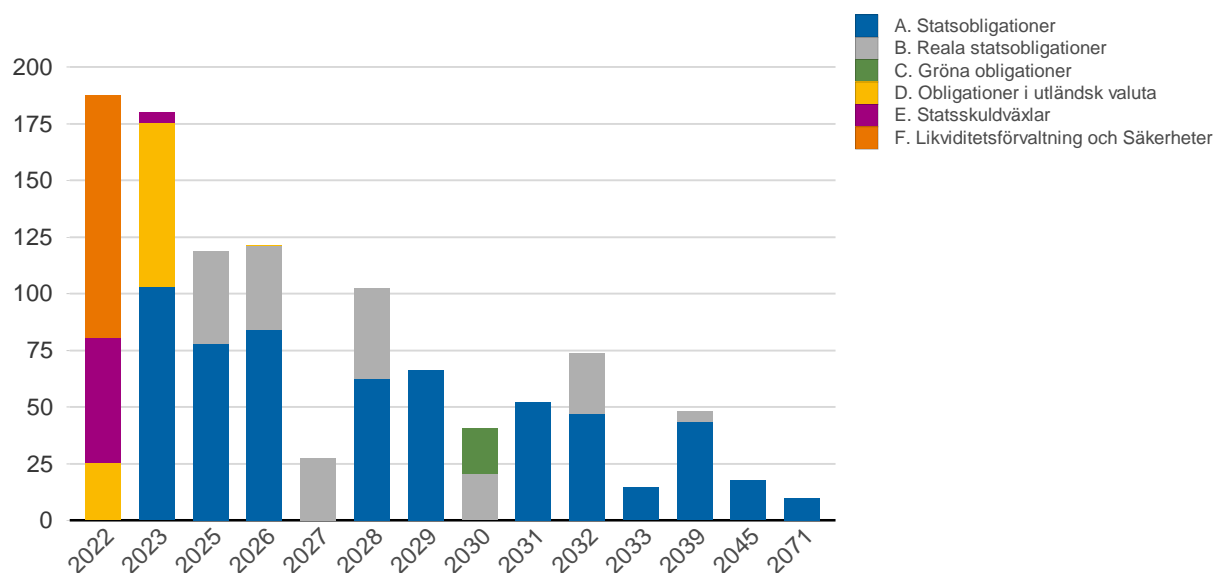
Statsobligationer, nominellt, mdkr



Reala statsobligationer, nominellt, mdkr

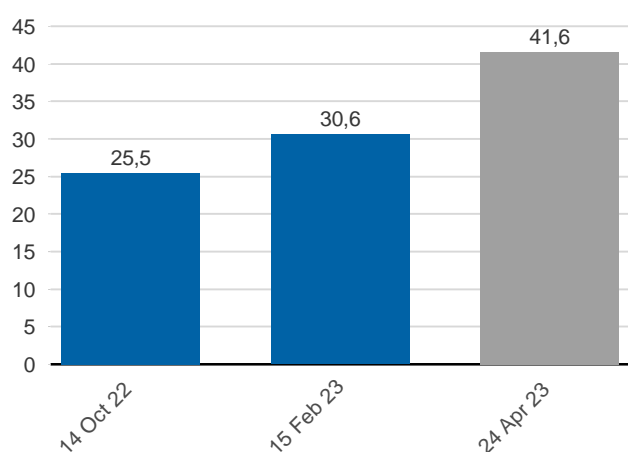


Förfalloprofil för hela skulden, aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar, mdkr



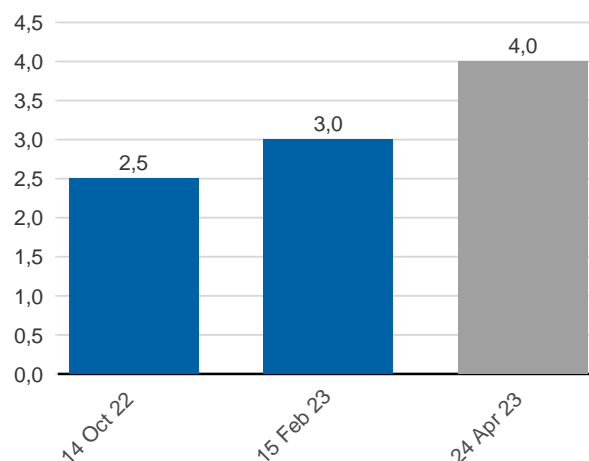
Publ. obligationer i euro och dollar, aktuell valutakurs, mdkr

EUR USD



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

EUR USD



Vidareutlåning

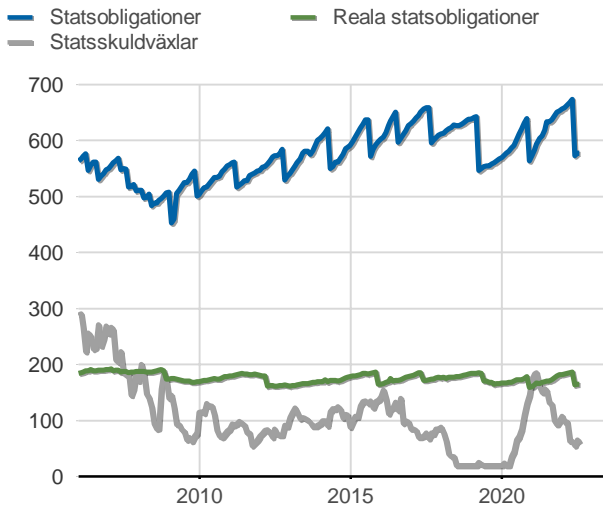
Mottagare	EUR	USD	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs
Vidareutlåning till Riksbanken, kapitalmarknad	4 000 000 000	5 500 000 000	85 976 611 760	97 660 145 000
	4 000 000 000	5 500 000 000	85 976 611 760	97 660 145 000

Vidareutlåning till Riksbanken, förfall

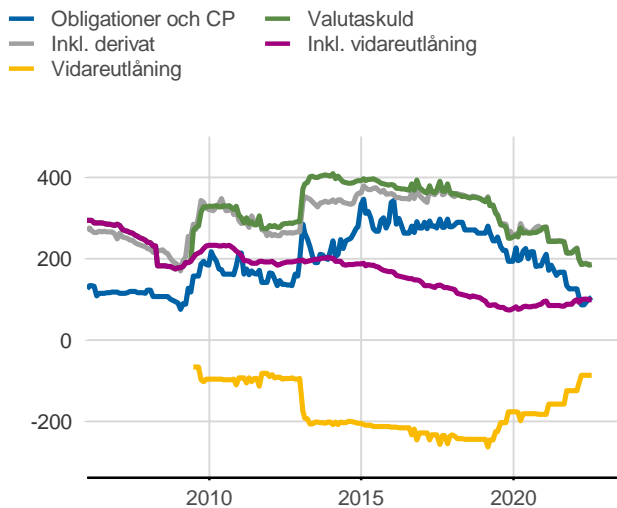
Aktuell valutakurs, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
	0	97 660 145 000	97 660 145 000
Nominellt belopp, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
2022-10-14	0	22 277 000 000	22 277 000 000
2023-02-15	0	24 396 900 000	24 396 900 000
2023-04-24	0	39 302 711 760	39 302 711 760
	0	85 976 611 760	85 976 611 760

Förfalldatum	Dollar	Euro
Nominellt belopp, respektive valuta		
2022-10-14	2 500 000 000	0
2023-02-15	3 000 000 000	0
2023-04-24	0	4 000 000 000
	5 500 000 000	4 000 000 000

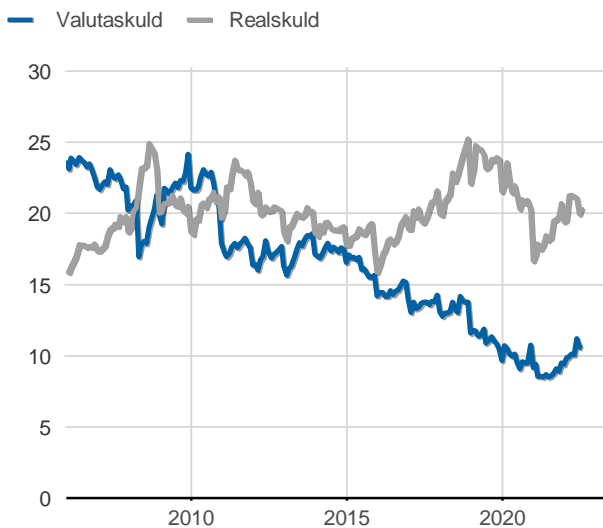
Statsobligationer, reaala statsobligationer och statsskuldväxlar, nominella belopp, mdkr



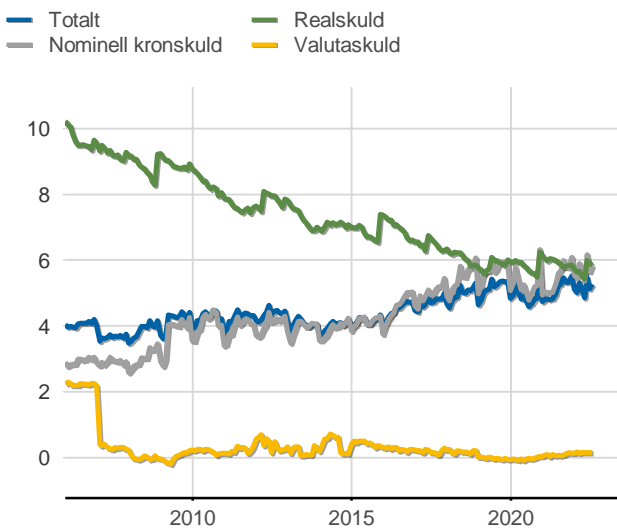
Valutaskuld inkl. vidareutlåning uppdelat på instrument, nominella belopp, mdkr



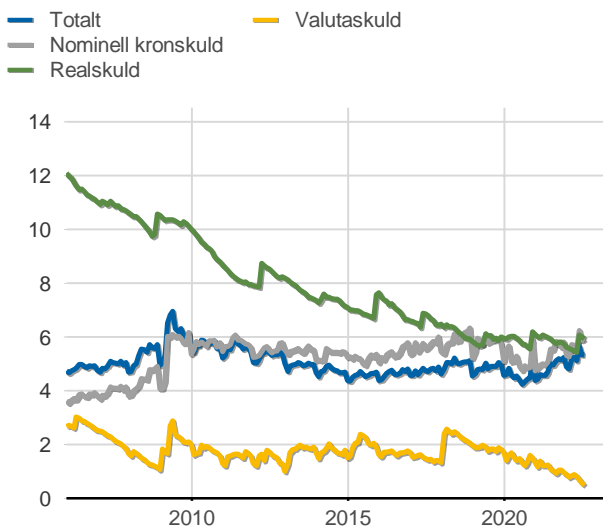
Skuldandelar, inklusive vidareutlåning, procent



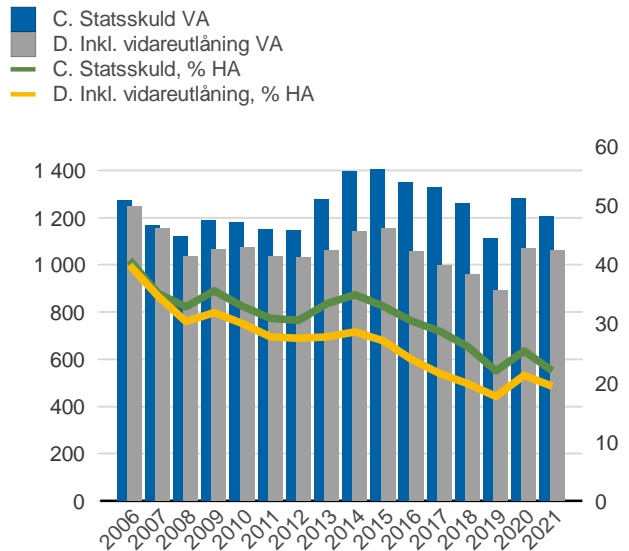
Duration för den totala skulden och respektive skuldslag, inkl. vidareutlåning, år



Återstående löptid till förfall, exklusive vidareutlåning, år



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



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

Kronor	Statsobligationer	577 666 450 000	56,9	577 666 450 000	62,2	0
	Reala statsobligationer	164 551 290 000	16,2	164 551 290 000	17,7	0
	Likviditetsförvaltning	89 669 289 308	8,8	89 669 289 308	9,7	0
	Statsskuldväxlar	59 983 000 000	5,9	59 983 000 000	6,5	0
	Gröna obligationer	20 000 000 000	2,0	20 000 000 000	2,2	0
	Övriga kapitalmarknadsskulder	1 000 000	0,0	1 000 000	0,0	0
	Säkerheter	-1 386 999 489	-0,1	-1 386 999 489	-0,1	0
		910 484 029 819	89,7	910 484 029 819	98,0	0
Utländsk valuta	Likviditetsförvaltning	18 425 443 838	1,8	18 425 443 838	2,0	0
	Obligationer i utländsk valuta	86 271 702 000	8,5	295 090 240	0,0	85 976 611 760
	Säkerheter	-597 804 340	-0,1	-597 804 340	-0,1	0
		104 099 341 498	10,3	18 122 729 738	2,0	85 976 611 760
		1 014 583 371 317	100,0	928 606 759 557	100,0	85 976 611 760

Statsobligationer, reala statsobligationer, obligationer i utländsk valuta och statsskuldväxlar

Instrument	Obligationer	Serie	Valuta	ISIN-nummer	ISIN US 144A	Kupong-ränta	Utgivningsdag	Förfallodag	Ursprunglig löptid	Volym resp. valuta	
Statsobligationer	SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	1057	SEK	SE0004869071	-	1,5	2012-10-22	2023-11-13	11,1	103 135 000 000	
	SGB 1058 2.5% 12 May 25	1058	SEK	SE0005676608	-	2,5	2014-02-03	2025-05-12	11,3	77 626 000 000	
	SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	1059	SEK	SE0007125927	-	1	2015-05-22	2026-11-12	11,5	83 914 000 000	
	SGB 1060 0.75% 12 May 28	1060	SEK	SE0009496367	-	0,75	2017-01-27	2028-05-12	11,3	62 513 000 000	
	SGB 1061 0.75% 12 Nov 29	1061	SEK	SE0011281922	-	0,75	2018-06-01	2029-11-12	11,5	66 339 000 000	
	SGB 1062 0.125% 12 May 31	1062	SEK	SE0013935319	-	0,125	2020-03-27	2031-05-12	11,1	52 140 000 000	
	SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	1056	SEK	SE0004517290	-	2,25	2012-03-20	2032-06-01	20,2	46 814 000 000	
	SGB 1065 1.75% 11 Nov 33	1065	SEK	SE0017830730	-	1,75	2022-05-06	2033-11-11	11,5	14 500 000 000	
	SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	1053	SEK	SE0002829192	-	3,5	2009-03-30	2039-03-30	30,0	43 213 450 000	
	SGB 1063 0.5% 24 Nov 45	1063	SEK	SE0015193313	-	0,5	2020-11-24	2045-11-24	25,0	17 472 000 000	
	SGB 1064 1.375% 23 Jun 71	1064	SEK	SE0016102115	-	1,375	2021-06-23	2071-06-23	50,0	10 000 000 000	
	Reala statsobligationer	SGB IL 3109 1.0% 1 Jun 25	3109	SEK	SE0005703550	-	1	2014-02-11	2025-06-01	11,3	35 153 000 000
		SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	3112	SEK	SE0008014062	-	0,125	2016-02-15	2026-06-01	10,3	31 658 000 000
		SGB IL 3113 0.125% 1 Dec 27	3113	SEK	SE0009548704	-	0,125	2017-02-06	2027-12-01	10,8	23 866 000 000
		SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	3104	SEK	SE0000556599	-	3,5	1999-04-22	2028-12-01	29,6	27 846 290 000
		SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	3103	SEK	SE0000479453	-	3,5	1998-06-26	2028-12-01	30,5	1 000 000
		SGB IL 3114 0.125% 1 Jun 30	3114	SEK	SE0013748258	-	0,125	2020-02-10	2030-06-01	10,3	18 906 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32		3111	SEK	SE0007045745	-	0,125	2015-04-30	2032-06-01	17,1	22 553 500 000	
SGB IL 3115 0.125% 1 Jun 39		3115	SEK	SE0016786560	-	0,125	2021-09-06	2039-06-01	17,7	4 568 500 000	
Publika obligationer, utländsk valuta	EUB USD 0.125% 14 Oct 22		USD	XS2243306003	US87020D2B95	0,125	2020-10-14	2022-10-14	2,0	2 500 000 000	
	EUB USD 2.375% 15 Feb 23		USD	XS1748232862	US87020DBC74	2,375	2018-01-11	2023-02-15	5,1	3 000 000 000	
	EUB EUR 0.125% 24 Apr 23		EUR	XS1756338551	XS1756368202	0,125	2018-01-24	2023-04-24	5,2	4 000 000 000	
	ESB EUR 9.405% 28 Dec 26		EUR	ES0273315038		9,405	1996-04-09	2026-12-28	30,7	33 205 918	
Statsskuldväxlar	STB 17 AUG 22		SEK	SE0017885486		-	ZC	2022-05-13	2022-08-17	0,3	10 000 000 000
	STB 21 Sep 22		SEK	SE0016787204		-	ZC	2021-09-03	2022-09-21	1,0	22 500 000 000
	STB 19 Okt 22		SEK	SE0018245821		-	ZC	2022-07-08	2022-10-19	0,3	10 000 000 000
	STB 21 Dec 22		SEK	SE0017133655		-	ZC	2021-12-10	2022-12-21	1,0	12 483 000 000
	STB 15 Mar 23		SEK	SE0017564297		-	ZC	2022-03-04	2023-03-15	1,0	5 000 000 000
Gröna obligationer	EUB G SEK 0.125% 9 Sep 30		SEK	XS2226974504	XS2226974413	0,125	2020-09-09	2030-09-09	10,0	20 000 000 000	

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). Tabellen visar det skuldmått som används i riskstyrningen som ett månadsgenomsnitt.

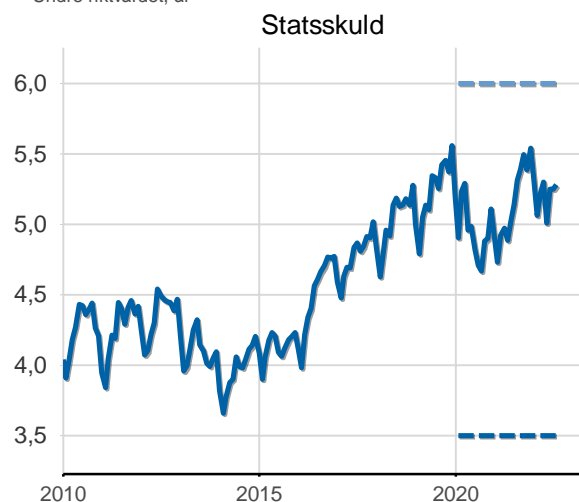
Andelar och löptid (duration) i Riksgäldens riskstyrning

	Skuldmått riskstyrning	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt
Nominell kronskuld	657 471 392 522	68,6	5,89
Real kronskuld	196 207 397 035	20,5	5,88
Valutaskuld	104 950 896 876	10,9	0,15
	958 629 686 434	100,0	5,28

Löptid (duration), år, månadsgenomsnitt

Riktvärdet för löptiden (duration) är fr.o.m. 2020:
Statsskuld, inom intervallet: 3,5-6 år

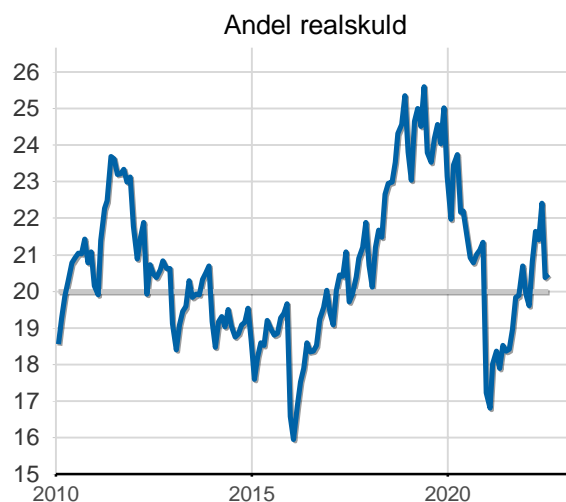
— Statsskuld, år
— Övre riktvärdet, år
— Undre riktvärdet, år



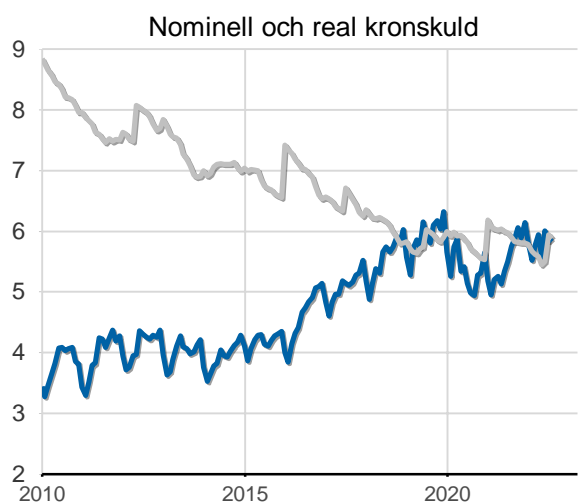
Skuldandelar, %, månadsgenomsnitt

Riktvärdena för skuldandelarna är fr.o.m. 2020:
Real kronskuld: 20 %
Valutaskuld: Statsskuldens exponering i utländsk valuta ska vara oförändrad

— Riktvärde för realskuden, %
— Realskuld, %



— Nominell kronskuld, år
— Realskuld, år



— Valutaskuld till aktuell valutakurs, mdkr

