



Sveriges statsskuld

29 september 2017

STATSSKULD

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
A. Nominellt belopp, inkl. förvaltningsstillgångar	-14 478 564 100	1 160 176 221 053
Upplupen inflationskompensation (uppräkningsbelopp)	1 105 593 172	23 149 119 878
Valutakurseffekter	8 476 605 415	9 607 441 242
B. Nominellt uppräknat belopp till aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar	-4 896 365 513	1 192 932 782 173
Förvaltningstillgångar, aktuell valutakurs	3 175 960 814	47 253 193 255
Officiellt mått på statens bruttoskuld:		
C. STATSSKULD	-1 720 404 699	1 240 185 975 428

STATENS SKULD INKL. VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
Vidareutlåning	-5 815 311 720	-242 499 631 220
Förvaltningstillgångar	-3 175 960 814	-47 253 193 255
D. STATENS SKULD INKLUSIVE VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR	-10 711 677 233	950 433 150 953

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 1052 4.25% 12 Mar 19	2007-11-26	1,4	1,4		0	98 550 120 000
SGB 1047 5% 1 Dec 20	2004-02-02	3,2	2,9		0	96 053 780 000
SGB 1054 3.5% 1 Jun 22	2011-02-14	4,7	4,4		0	101 130 500 000
SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	2012-10-22	6,1	5,8		2 000 000 000	84 477 000 000
SGB 1058 2.5% 12 May 25	2014-02-03	7,6	7,0		0	59 376 000 000
SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	2015-05-22	9,1	8,7		0	60 391 000 000
SGB 1060 0,75% 12 May 28	2017-01-27	10,6	10,2		2 000 000 000	40 365 000 000
SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	2012-03-20	14,7	12,7		1 000 000 000	15 000 000 000
SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	2009-03-30	21,5	16,2		0	45 250 450 000
		6,8	6,1		5 000 000 000	600 593 850 000

Reala statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Inflationskompensation	Inkl. inflationskomp.	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19	2015-02-09	1,7	1,7	743 483 659	23 834 483 659	-515 000 000	23 091 000 000
SGB IL 3102 4% 1 Dec 20	1996-06-06	3,2	3,0	11 792 069 685	48 584 119 685	487 000 000	36 792 050 000
SGB IL 3108 0.25% 1 Jun 22	2011-09-20	4,7	4,6	1 127 389 668	29 483 389 668	175 000 000	28 356 000 000
SGB IL 3109 1% 1 Jun 25	2014-02-11	7,7	7,4	736 767 460	25 217 767 460	-303 000 000	24 481 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	2016-02-15	8,7	8,6	461 185 473	15 068 185 473	176 000 000	14 607 000 000
SGB IL 3113 0,125% 1 Dec 27	2017-02-06	10,2	10,1	143 118 089	8 337 118 089	270 000 000	8 194 000 000
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	1998-06-26	11,2	9,6	961 518	3 961 518	0	3 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	1999-04-22	11,2	9,6	7 752 250 469	37 195 540 469	77 000 000	29 443 290 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	2015-04-30	14,7	14,5	391 893 857	9 827 893 857	439 000 000	9 436 000 000
		6,6	6,4	23 149 119 878	197 552 459 878	806 000 000	174 403 340 000

Publika obligationer i utländsk valuta

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs	Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB USD 1% 13 Nov 17	2014-11-13	0,1	0,1	3 000 000 000	24 486 000 000	0	22 146 600 000
EUB USD 0.875% 23 Jan 18	2015-01-23	0,3	0,3	2 500 000 000	20 405 000 000	0	20 280 125 000
EUB USD 1% 27 Feb 18	2013-02-27	0,4	0,4	3 000 000 000	24 486 000 000	0	18 877 500 000
EUB USD 1.125% 15 May 18	2015-05-13	0,6	0,6	2 250 000 000	18 364 500 000	0	18 447 975 000
EUB USD 1% 5 Oct 18	2015-10-05	1,0	1,0	1 000 000 000	8 162 000 000	0	8 420 700 000
EUB USD 1,125% 15 Mar 19	2016-03-15	1,5	1,5	2 000 000 000	16 324 000 000	0	16 938 600 000
EUB USD 1,500% 25 Jul 19	2017-07-25	1,8	1,8	2 750 000 000	22 445 500 000	0	22 781 550 000
EUB USD 1,125% 21 Oct 19	2016-10-21	2,1	2,0	3 000 000 000	24 486 000 000	0	26 488 500 000
EUB USD 1,625% 24 Mar 20	2015-03-24	2,5	2,5	2 000 000 000	16 324 000 000	0	17 267 112 500
EUB USD 1,625% 6 Apr 20	2017-04-06	2,5	2,5	2 000 000 000	16 324 000 000	0	17 711 600 000
EUB USD 1,25% 8 Sep 21	2016-09-08	3,9	3,9	2 000 000 000	16 324 000 000	0	17 080 800 000
EUB EUR 0.875% 31 Jan 18	2013-01-31	0,3	0,3	4 000 000 000	38 593 200 800	0	34 763 460 000
EUB EUR 0.75% 2 May 19	2014-05-02	1,6	1,6	2 250 000 000	21 708 675 450	0	20 402 744 918
EUB EUR 0.05% 12 Feb 20	2015-02-12	2,4	2,4	1 500 000 000	14 472 450 300	0	14 156 448 840
ESB EUR 9.405% 28 Dec 26	1996-04-09	9,3	7,0	60 101 210	579 874 516	0	534 099 996
		1,4	1,3		283 485 201 066	0	276 297 816 254

Privatplaceringar i utländsk valuta m.m.

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

Summa: Kapitalmarknad

5 806 000 000 1 051 295 006 254

PENNINGMARKNAD

Statsskuldväxlar

Statsskuldväxel	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
STB 20 Sep 17	2017-03-03	-	-	-22 500 000 000	0
STB 18 Oct 17	2017-07-07	0,1	0,0	0	10 000 000 000
STB 15 Nov 17	2017-08-04	0,1	0,1	0	20 000 000 000
STB 20 Dec 17	2017-06-09	0,2	0,2	0	17 500 000 000
STB 21 Mar 18	2017-09-01	0,5	0,5	20 000 000 000	27 500 000 000
		0,3	0,3	-2 500 000 000	75 000 000 000

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	0	-270 900	-203 730
Bankkonton, utländsk valuta	185 292 680	2 408 996 799	161 295 930
Banklån mm	3 678 000 000	-9 090 090 000	3 678 000 000
Banklån, konton mm	3 863 292 680	-6 681 364 101	3 839 092 200
Repor, Reala statsobligationer	1 208 817 765	-2 899 555 802	-217 311 598
Repor, Statsobligationer	50 581 257 204	-896 080 578	49 492 774 832
Repor, Statsskuldväxlar	0	-311 483 433	-2 599 307 516
Repor, svenska statspapper	51 790 074 969	-4 107 119 813	46 676 155 718
Riksbankscertifikat, innehav	0	-5 000 000 000	-40 000 000 000
Värdepappersinnehav	0	-5 000 000 000	-40 000 000 000
	55 653 367 649	-15 788 483 914	10 515 247 918

Säkerheter

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Credit Support Annex till ISDA, SEK	3 413 400 000	743 000 000	3 413 400 000
Credit Support Annex till ISDA, utländsk valuta	5 647 150 107	-2 364 195 158	5 647 150 107
Marginalsäkerheter, Futures	0	17 771 470	-177 948 060
Säkerheter under central motpartsclearing	4 405 603 019	-385 974 091	2 468 477 555
	13 466 153 126	-1 989 397 779	11 351 079 602

Summa: Penningmarknad

-20 277 881 693 96 866 327 520

PRIVATMARKNAD

Premieobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utgivet	Behållet	Förändring	Nominellt belopp, kr
SLB 2015:2 0.1% 1 Nov 17	2015-11-27	0,1	0,1	1 500 000 000	-95 100 000	0	1 404 900 000
SLB 2013:1 0.7% 16 Maj 18	2013-05-22	0,6	0,6	2 100 000 000	-67 040 000	0	2 032 960 000
SLB 2016:1 0.1% 16 Maj 18	2016-05-09	0,6	0,6	1 400 000 000	-5 485 000	0	1 394 515 000
SLB 2013:2 1.0% 13 Nov 18	2013-11-12	1,1	1,1	2 100 000 000	-29 175 000	0	2 070 825 000
SLB 2014:1 0.8% 7 Maj 19	2014-04-30	1,6	1,6	2 100 000 000	-63 635 000	0	2 036 365 000
SLB 2014:2 0.6% 2 Dec 21	2014-11-26	4,2	4,1	2 900 000 000	-10 515 000	0	2 889 485 000
		1,7	1,7	12 100 000 000	-270 950 000	0	11 829 050 000

Riksgäldsspar

Kontoform	Förändring	Nominellt belopp, kr
Riksgäldsspar, nominellt	-5 122 711	134 089 818
Riksgäldsspar, realt	-1 559 696	51 747 462
	-6 682 407	185 837 280

Summa: Privatmarknad

-6 682 407 12 014 887 280

ALLA MARKNADER INKL. FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

Förändring Nominellt belopp

Summa nominella belopp. Under A på sidan 1.

-14 478 564 100 1 160 176 221 053

APPENDIX

Olika skuldsdrag, inklusive vidareutlåning och förvaltningsstillgångar

Skuldsdrag	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs och uppräkningsbelopp	Löptid	Duration	Andel
Nominell kronskuld	621 468 707 193	621 468 707 193	5,83	5,18	65,4
Real kronskuld	174 455 087 462	197 604 207 340	6,61	6,39	20,8
Valutaskuld	129 336 751 765	131 360 236 421	1,34	0,07	13,8
	925 260 546 420	950 433 150 953	4,84	4,83	100,0

Nominell kronskuld, inklusive förvaltningsstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr
Statsobligationer	600 593 850 000
Statsskuldväxlar	75 000 000 000
Privatmarknad	11 963 139 818
Likviditetsförvaltning	10 353 951 988
Säkerheter	5 882 018 600
Valutaterminer, SEK	825 746 786
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	-83 150 000 000
	621 468 707 193

Real kronskuld

Instrument	Nominellt belopp, kr	Inflationskompensation, kr	Real kronskuld, kr
Reala statsobligationer	174 403 340 000	23 149 119 878	197 552 459 878
Riksgäldsspar, realt	51 747 462	0	51 747 462
	174 455 087 462	23 149 119 878	197 604 207 340

Valutaskuld, inkl. vidareutlåning och penningmarknadstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr	Valutakurseffekter, kr	Valutaskuld, kr
Publika obligationer, utländsk valuta	275 763 716 258	7 141 610 293	282 905 326 550
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	83 150 000 000	3 403 576 883	86 553 576 883
Säkerheter	5 469 061 002	0	5 469 061 002
Likviditetsförvaltning	161 295 930	0	161 295 930
Övriga valutaskulder	534 099 996	-983 052 890	-448 952 894
Valutaterminer, SEK	-825 746 786	45 306 957	-780 439 829
Vidareutlåning	-234 915 674 634	-7 583 956 587	-242 499 631 220
	129 336 751 765	2 023 484 656	131 360 236 421

Valutaskuld exklusive vidareutlåning	364 252 426 399	9 607 441 242	373 859 867 641
--------------------------------------	-----------------	---------------	-----------------

Swappar, nominellt nettobelopp med fast ränta i kronor

Förfalloår	Ränteswappar i kronor, kr	Ränteswappar mellan kronor och utländska valutor, kr	Ränteswappar totalt, kr
2017	1 750 000 000	9 350 000 000	11 100 000 000
2018	20 800 000 000	7 750 000 000	28 550 000 000
2019	14 600 000 000	26 300 000 000	40 900 000 000
2020	19 700 000 000	10 000 000 000	29 700 000 000
2021	26 000 000 000	11 250 000 000	37 250 000 000
2022	16 250 000 000	12 500 000 000	28 750 000 000
2023	7 750 000 000	5 000 000 000	12 750 000 000
2024	5 000 000 000	2 500 000 000	7 500 000 000
2025	6 650 000 000	0	6 650 000 000
2026	2 000 000 000	0	2 000 000 000
2027	400 000 000	0	400 000 000
	120 900 000 000	84 650 000 000	205 550 000 000

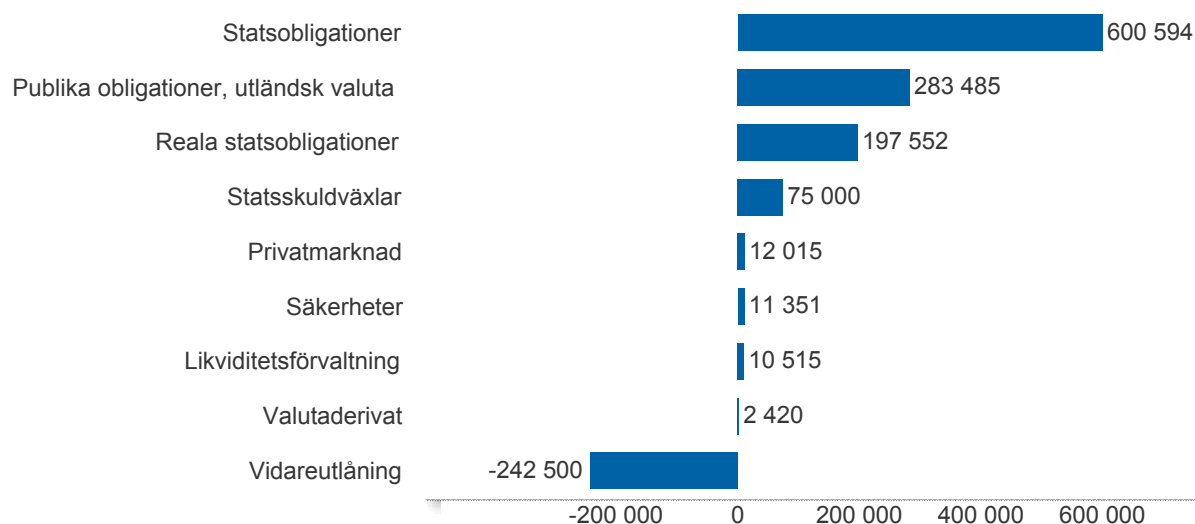
Skulder och tillgångar i likviditetsförvaltning och betalning av säkerheter

Instrument	Nominellt belopp	Bruttoskuld	Tillgångar	Aktuell valutakurs
Banklån, konton mm	3 839 092 200	3 863 292 680	-24 200 480	-24 200 480
Credit Support Annex till ISDA	9 060 550 107	9 060 550 107	0	0
Marginalsäkerheter, Futures	-177 948 060	0	-177 948 060	-177 948 060
Repör, svenska statspapper	46 676 155 718	51 790 074 969	-5 113 919 251	-5 113 919 251
Säkerheter under central motparts clearing	2 468 477 555	4 405 603 019	-1 937 125 464	-1 937 125 464
Värdepappersinnehav	-40 000 000 000	0	-40 000 000 000	-40 000 000 000
	21 866 327 520	69 119 520 775	-47 253 193 255	-47 253 193 255

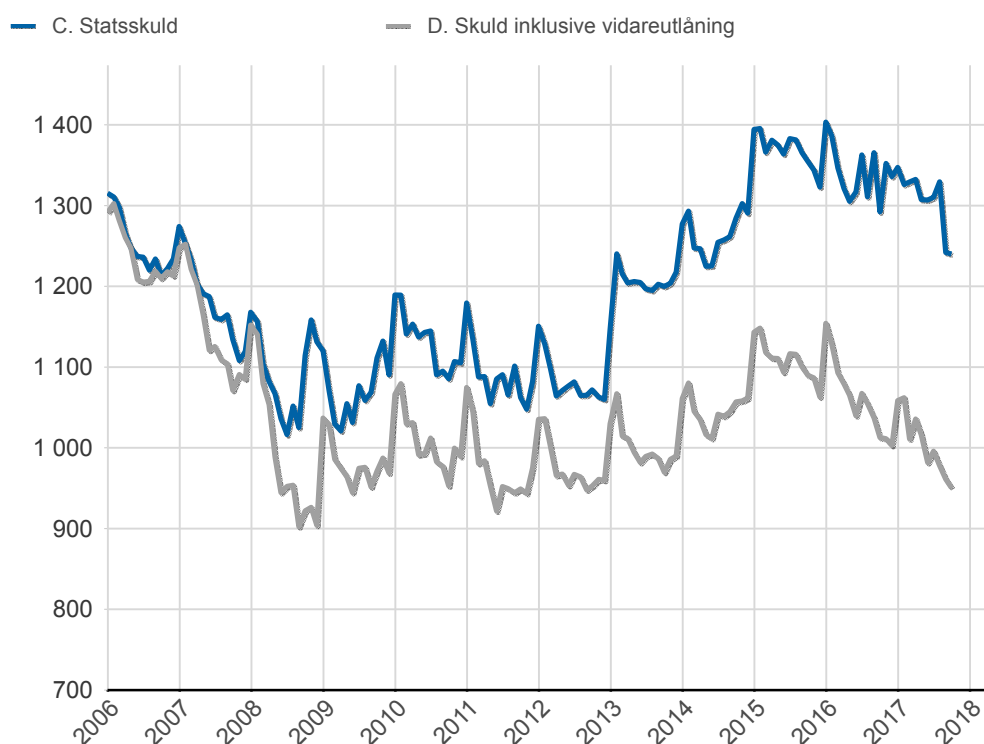
Översikt av statens skuld, mnkr

	A. Nominellt belopp	B. Aktuella valutakurser	Andel %	Löptid år	Duration år	C. Stats- skuld	D. Inkl. vidare- utlåning	Andel %	D. Marknads- värde
Statsobligationer	600 594	600 594	50,3	6,8	6,1	600 594	600 594	63,2	684 962
Reala statsobligationer	174 403	197 552	16,6	6,6	6,4	197 552	197 552	20,8	243 398
Publika obligationer, utländsk valuta	276 298	283 485	23,8	1,4	1,3	283 485	283 485	29,8	284 272
Kapitalmarknad	1 051 295	1 081 632	90,7	5,3	5,1	1 081 632	1 081 632	113,8	1 212 632
Statsskuldväxlar	75 000	75 000	6,3	0,3	0,3	75 000	75 000	7,9	75 137
Säkerheter	11 351	11 351	1,0	0,0	0,0	13 466	11 351	1,2	11 471
Likviditetsförvaltning	10 515	10 515	0,9	-0,0	-0,0	55 653	10 515	1,1	10 513
Penningmarknad	96 866	96 866	8,1	0,2	0,2	144 120	96 866	10,2	97 122
Premieobligationer	11 829	11 829	1,0	1,7	1,7	11 829	11 829	1,2	12 010
Riksgäldsspar	186	186	0,0	0,9	0,9	186	186	0,0	187
Privatmarknad	12 015	12 015	1,0	1,7	1,7	12 015	12 015	1,3	12 197
Valutaderivat	0	2 420	0,2	-	40,8	2 420	2 420	0,3	-5 496
Räntederivat	0	0	0,0	-	60,1	0	0	0,0	-8 354
Derivatmarknad	0	2 420	0,2	-	52,4	2 420	2 420	0,3	-13 850
Vidareutlåning	0	0	0,0	-	-	0	-242 500	-25,5	-242 453
	1 160 176	1 192 933	100,0	4,8	4,2	1 240 186	950 433	100,0	1 065 648

D. Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mnkr

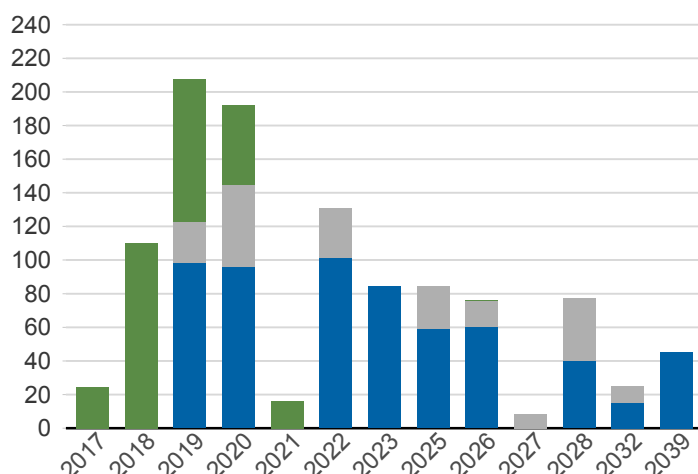


Statsskuld och Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mdkr



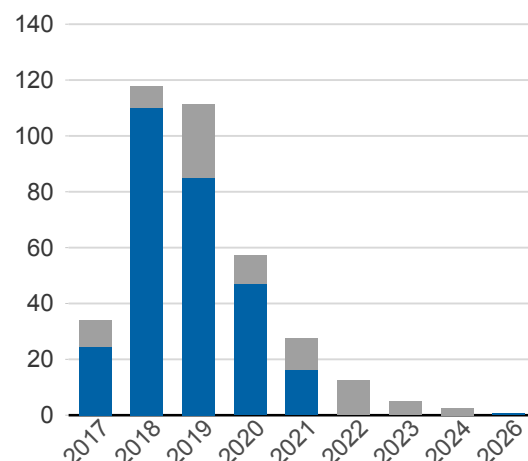
Kapitalmarknadsförfall, uppräknade belopp till aktuella valutakurser, mdkr

■ Obligationer, utländsk valuta ■ Statsobligationer
■ Reala statsobligationer

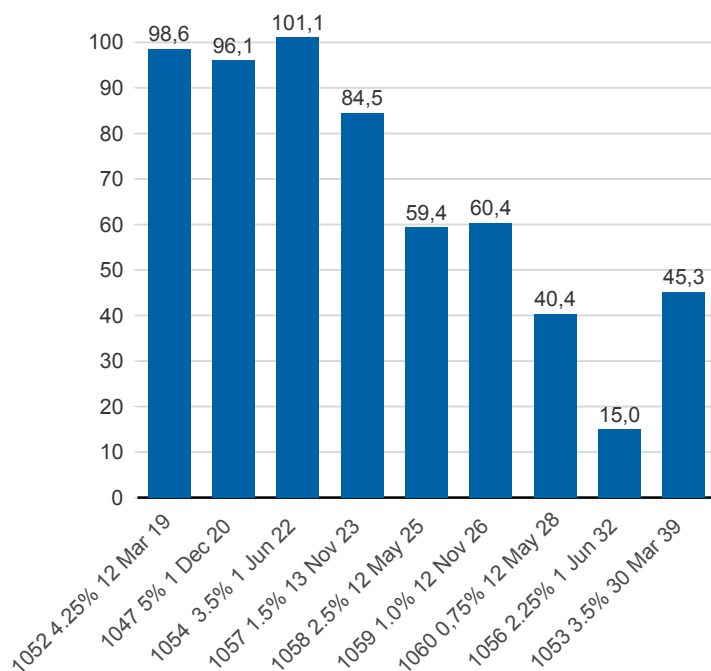


Valutaskuld på kapitalmarknaden inklusive swappar, aktuell valutakurs, mdkr

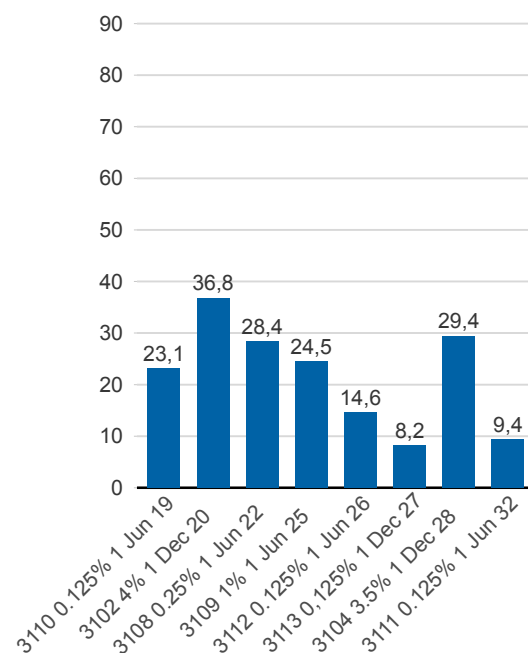
■ Ränteswappar mellan SEK och utländska valutor
■ Obligationer i utländsk valuta



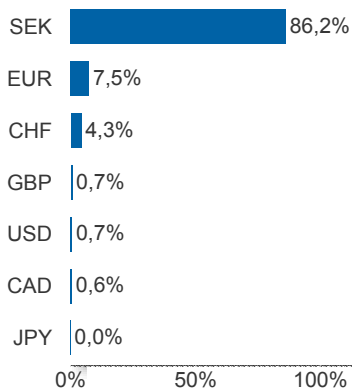
Statsobligationer, nominellt, mdkr



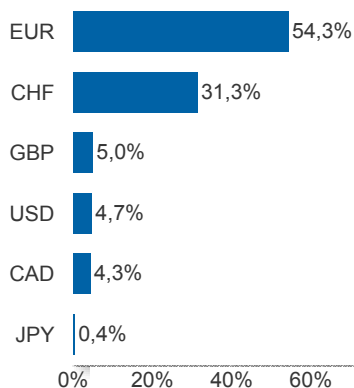
Reala statsobligationer, nominellt, mdkr



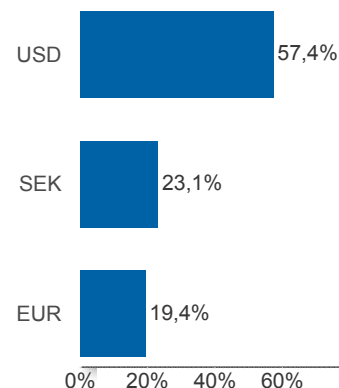
Valutaexponering, skulder och fordringar i vidareutlåningen, netto, %



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

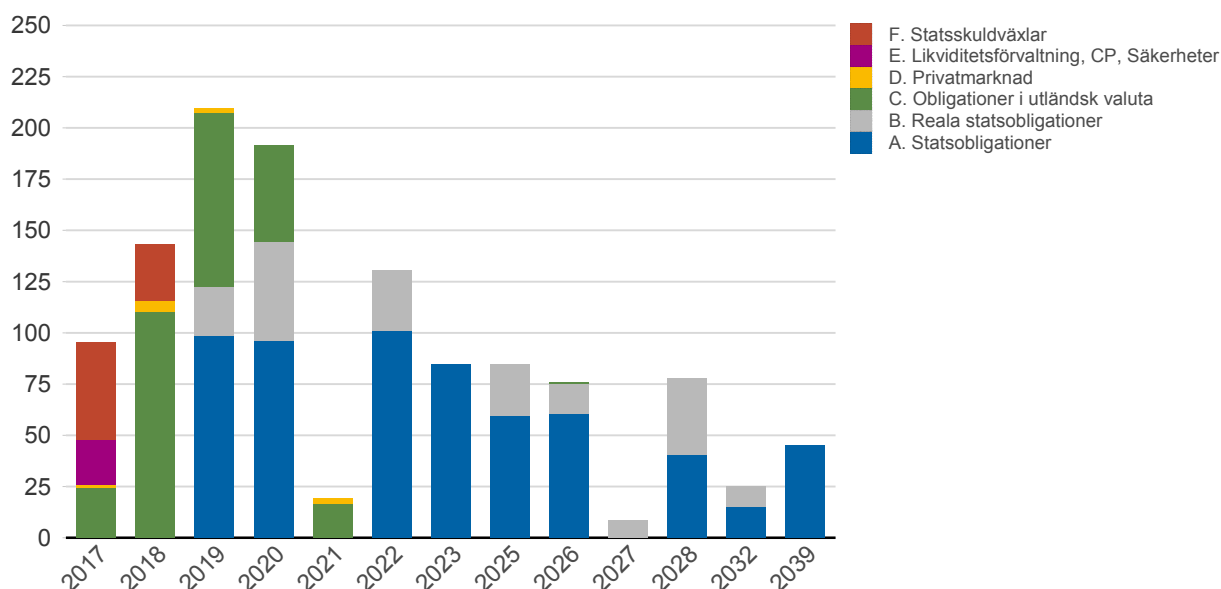


Finansiering av valutaskulden, inklusive finansiering av vidareutlåningen, brutto, %



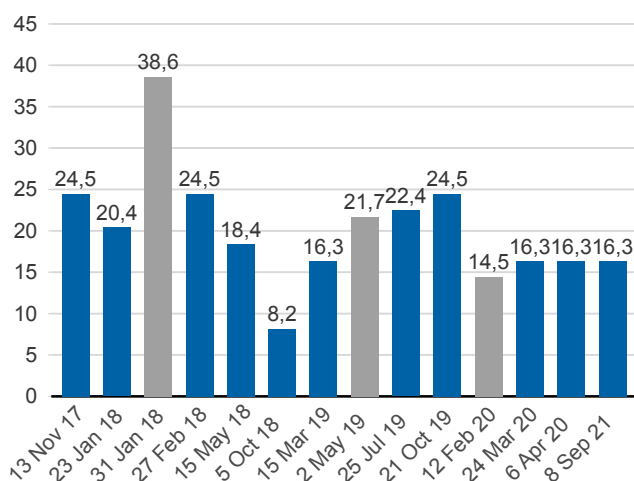
Anm: Finansieringen i SEK avser kronskuld som i kombination med swappar ger exponering i utländsk valuta.

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



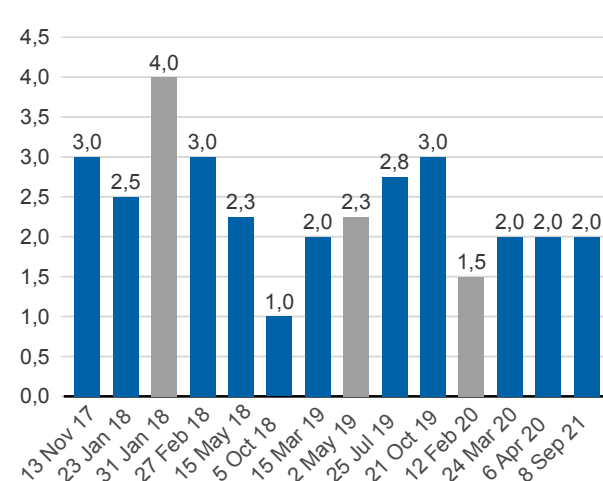
Publ. obligationer i euro och dollar, aktuell valutakurs, mdkr

EUR USD



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

EUR USD



Vidareutlåning

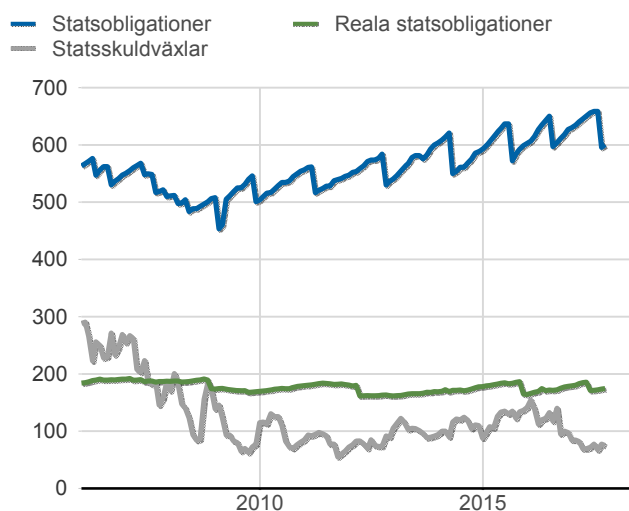
Mottagare	EUR	USD	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs
Vidareutlåning till Irland	600 000 000	0	5 242 515 794	5 788 980 120
Vidareutlåning till Riksbanken, kapitalmarknad	5 500 000 000	22 500 000 000	229 673 158 840	236 710 651 100
	6 100 000 000	22 500 000 000	234 915 674 634	242 499 631 220

Vidareutlåning till Riksbanken, förfall

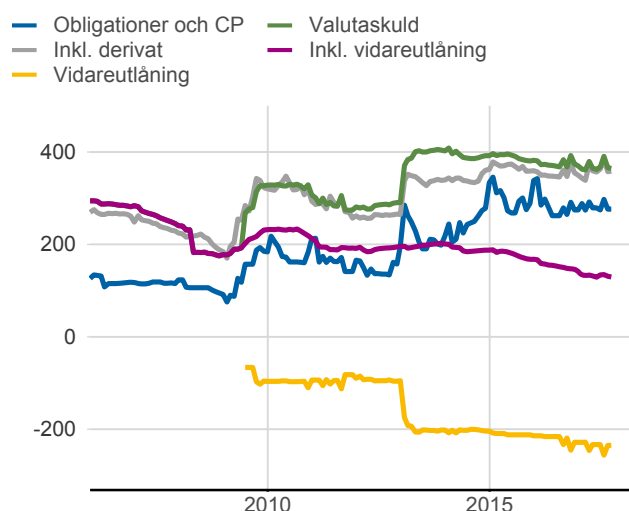
Aktuell valutakurs, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
	0	236 710 651 100	236 710 651 100
Nominellt belopp, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
2017-11-13	0	22 146 600 000	22 146 600 000
2018-01-23	0	20 280 125 000	20 280 125 000
2018-01-31	0	34 763 460 000	34 763 460 000
2018-02-27	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
2019-07-25	0	22 781 550 000	22 781 550 000
2019-10-21	0	26 488 500 000	26 488 500 000
2020-02-12	0	14 156 448 840	14 156 448 840
2020-04-06	0	17 711 600 000	17 711 600 000
2021-09-08	0	17 080 800 000	17 080 800 000
	0	229 673 158 840	229 673 158 840

Förfalldatum	Dollar	Euro
Nominellt belopp, respektive valuta		
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
2019-07-25	2 750 000 000	0
2019-10-21	3 000 000 000	0
2020-02-12	0	1 500 000 000
2020-04-06	2 000 000 000	0
2021-09-08	2 000 000 000	0
	22 500 000 000	5 500 000 000

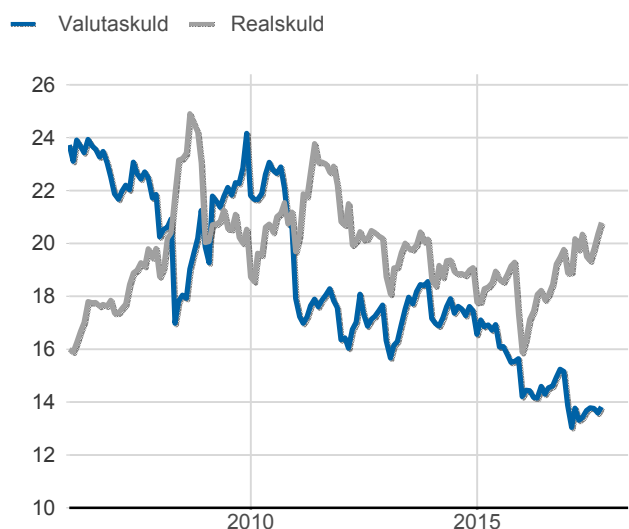
Statsobligationer, reaala statsobligationer och statsskuldväxlar, nominella belopp, mdkr



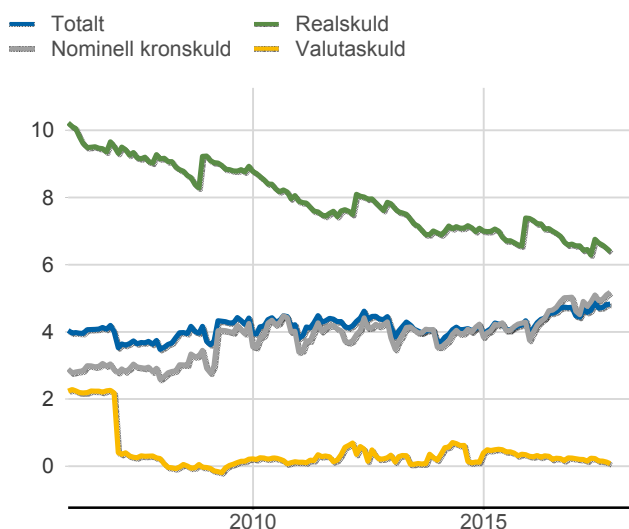
Valutaskuld inkl. vidareutlåning uppdelat på instrument, nominella belopp, mdkr



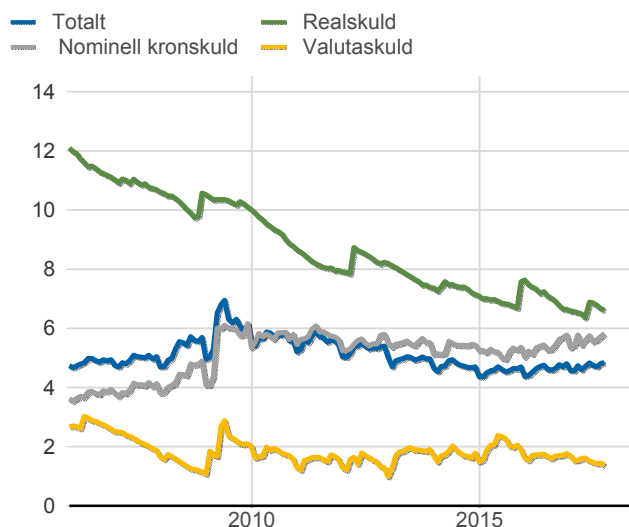
Skuldandelar, inklusive vidareutlåning, procent



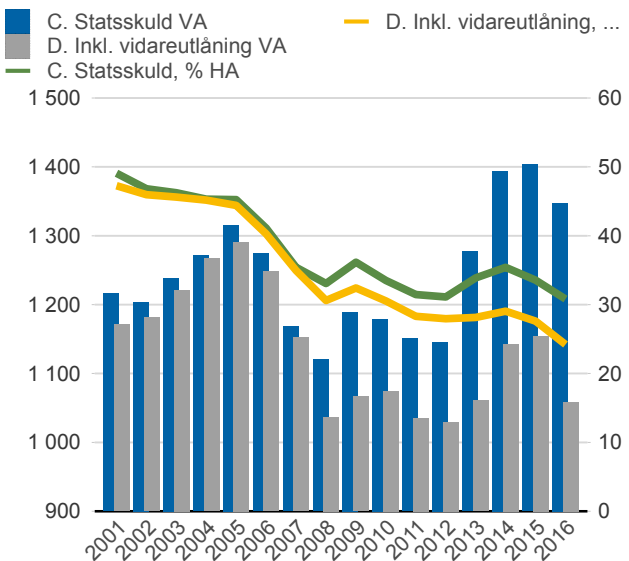
Duration för den totala skulden och respektive skuldslag, inkl. vidareutlåning, år



Återstående löptid till förfall, exklusive vidareutlåning, år

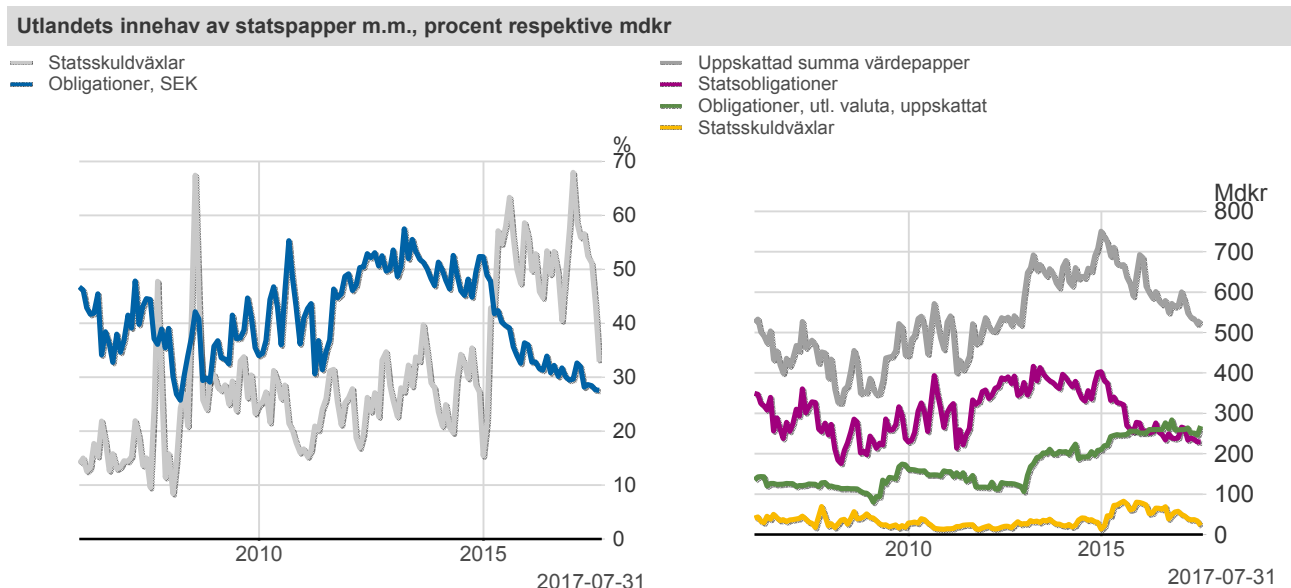


Statsskuld resp. Statens skuld inkl. vidareutlåning, mdkr och procent av BNP



Anm: Återstående löptid 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	600 593 850 000	51,8	595 351 334 207	64,3	5 242 515 794
	Reala statsobligationer	174 400 340 000	15,0	174 400 340 000	18,8	0
	Statsskuldväxlar	75 000 000 000	6,5	75 000 000 000	8,1	0
	Premieobligationer	11 829 050 000	1,0	11 829 050 000	1,3	0
	Säkerheter	5 882 018 600	0,5	5 882 018 600	0,6	0
	Likviditetsförvaltning	10 353 951 988	0,9	10 353 951 988	1,1	0
	Riksgäldsspar	185 837 280	0,0	185 837 280	0,0	0
	Övriga kapitalmarknadsskulder	3 000 000	0,0	3 000 000	0,0	0
		878 248 047 868	75,7	873 005 532 075	94,4	5 242 515 794
Utländsk valuta	Obligationer i utländsk valuta	276 297 816 254	23,8	46 624 657 414	5,0	229 673 158 840
	Säkerheter	5 469 061 002	0,5	5 469 061 002	0,6	0
	Likviditetsförvaltning	161 295 930	0,0	161 295 930	0,0	0
		281 928 173 185	24,3	52 255 014 345	5,6	229 673 158 840
		1 160 176 221 053	100,0	925 260 546 420	100,0	234 915 674 634



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	2004-02-02	2020-12-01	16,8	96 053 780 000
	SGB 1052 4.25% 12 Mar 19	1052	SEK	SE0002241083	-	4,25	2007-11-26	2019-03-12	11,3	98 550 120 000
	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	2011-02-14	2022-06-01	11,3	101 130 500 000
	SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	1056	SEK	SE0004517290	-	2,25	2012-03-20	2032-06-01	20,2	15 000 000 000
	SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	1057	SEK	SE0004869071	-	1,5	2012-10-22	2023-11-13	11,1	84 477 000 000
	SGB 1058 2.5% 12 May 25	1058	SEK	SE0005676608	-	2,5	2014-02-03	2025-05-12	11,3	59 376 000 000
	SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	1059	SEK	SE0007125927	-	1	2015-05-22	2026-11-12	11,5	60 391 000 000
	SGB 1060 0.75% 12 May 28	1060	SEK	SE0009496367	-	0,75	2017-01-27	2028-05-12	11,3	40 365 000 000
	SGB IL 3102 4% 1 Dec 20	3102	SEK	SE0000317943	-	4	1996-06-06	2020-12-01	24,5	36 792 050 000
	SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	3103	SEK	SE0000479453	-	3,5	1998-06-26	2028-12-01	30,5	3 000 000
	SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	3104	SEK	SE0000556599	-	3,5	1999-04-22	2028-12-01	29,6	29 443 290 000
	SGB IL 3108 0.25% 1 Jun 22	3108	SEK	SE0004211084	-	0,25	2011-09-20	2022-06-01	10,7	28 356 000 000
Reala statsobligationer	SGB IL 3109 1% 1 Jun 25	3109	SEK	SE0005703550	-	1	2014-02-11	2025-06-01	11,3	24 481 000 000
	SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19	3110	SEK	SE0006758736	-	0,125	2015-02-09	2019-06-01	4,3	23 091 000 000
	SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	3111	SEK	SE0007045745	-	0,125	2015-04-30	2032-06-01	17,1	9 436 000 000
	SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	3112	SEK	SE0008014062	-	0,125	2016-02-15	2026-06-01	10,3	14 607 000 000
	SGB IL 3113 0.125% 1 Dec 27	3113	SEK	SE0009548704	-	0,125	2017-02-06	2027-12-01	10,8	8 194 000 000
	ESB EUR 9.405% 28 Dec 26		EUR	ES0273315038		9,405	1996-04-09	2026-12-28	30,7	60 101 210
	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 EUR 0.75% 2 May 19		EUR	XS1062909384		0,75	2014-05-02	2019-05-02	5,0	2 250 000 000
	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
Publika obligationer, utländsk valuta	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	US87020DAW48	1,125	2016-03-15	2019-03-15	3,0	2 000 000 000
	EUB USD 1.25% 8 Sep 21		USD	XS1485745886	US87020DAX21	1,25	2016-09-08	2021-09-08	5,0	2 000 000 000
	EUB USD 1.125% 21 Oct 19		USD	XS1506497574	US87020DAY04	1,125	2016-10-21	2019-10-21	3,0	3 000 000 000
	EUB USD 1.625% 6 Apr 20		USD	XS1590796436	US87020DAZ78	1,625	2017-04-06	2020-04-06	3,0	2 000 000 000
	EUB USD 1,500% 25 Jul 19		USD	XS1650589259	US87020DBA19	1,5	2017-07-25	2019-07-25	2,0	2 750 000 000

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 måtten.

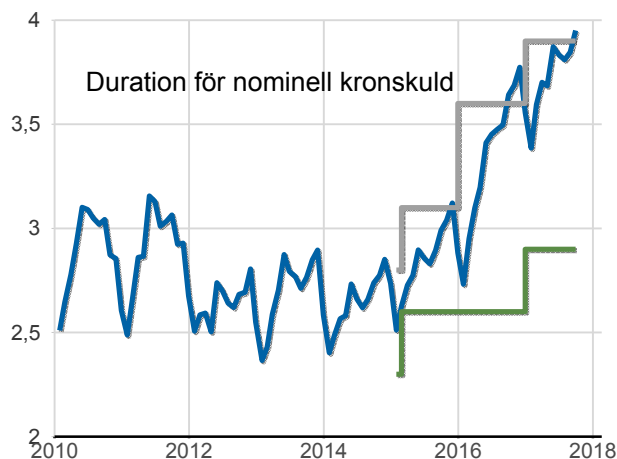
Andelar och löptid (duration) i Riksgäldens riskstyrning

	Statsskulden	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt	Skuldmått riskstyrning	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt
Nominell kronskuld	668 519 814 592	54,6	5,28	621 468 707 193	65,2	3,95
Real kronskuld	197 604 207 340	15,7	6,44	197 604 207 340	20,9	6,44
Valutaskuld	374 061 953 496	29,7	0,09	131 344 915 237	13,9	0,13
	1 240 185 975 428	100,0	4,91	950 417 829 769	100,0	4,06

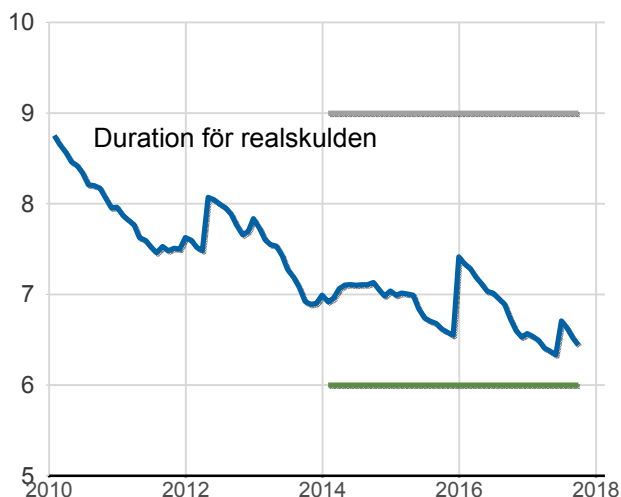
Löptid (duration), år, månadsgenomsnitt

Riktvärdena för löptiderna (duration) är fr.o.m. 2017:
Nominell kronskuld kortare än 12 år, inom intervallet: 2,9-3,9 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. 2017:
Real kronskuld: 20 %
Valutaskuld: 20 mdkr lägre skuld i USD, EUR, CAD och GBP än föregående år exkl. valutakursförändringar

— Riktvärde för realskulden, %
— Realskuld, %



— Valutaskuld till ursprunglig valutakurs, mdkr
— Valutaskuld till aktuell valutakurs, mdkr
— Valutaexp. i EUR, GBP, USD och CAD, mdkr fast valutakurs HA

