



Sveriges statsskuld

29 juli 2016

STATSSKULD

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
A. Nominellt belopp, inkl. förvaltningsstillgångar	-15 322 519 337	1 250 340 563 226
Upplupen inflationskompensation (uppräkningsbelopp)	423 503 582	18 905 335 020
Valutakurseffekter	4 761 456 504	36 826 786 432
B. Nominellt uppräknat belopp till aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar	-10 137 559 251	1 306 072 684 678
Förvaltningstillgångar, aktuell valutakurs	-41 753 074 121	4 823 741 772
Officiellt mått på statens bruttoskuld:		
C. STATSSKULD	-51 890 633 372	1 310 896 426 450

STATENS SKULD INKL. VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
Vidareutlåning	-2 412 303 055	-251 106 283 547
Förvaltningstillgångar	41 753 074 121	-4 823 741 772
D. STATENS SKULD INKLUSIVE VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR	-12 549 862 306	1 054 966 401 131

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 1050 3% 12 Jul 16	2005-09-19	-	-	-53 238 900 000	0
SGB 1051 3.75% 12 Aug 17	2006-09-15	1,0	1,0	0	65 525 775 000
SGB 1052 4.25% 12 Mar 19	2007-11-21	2,6	2,5	0	94 050 120 000
SGB 1047 5% 1 Dec 20	2004-01-28	4,3	3,9	0	95 053 780 000
SGB 1054 3.5% 1 Jun 22	2011-02-09	5,8	5,4	0	90 130 500 000
SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	2012-10-22	7,3	6,9	0	75 977 000 000
SGB 1058 2.5% 12 May 25	2014-02-03	8,8	8,0	0	62 872 000 000
SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	2015-05-22	10,3	9,8	0	57 147 000 000
SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	2012-03-20	15,9	13,7	0	12 000 000 000
SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	2009-03-30	22,7	17,3	0	44 250 450 000
		6,9	6,4	-53 238 900 000	597 006 625 000

Reala statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Inflationskompensation	Inkl. inflationskomp.	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB IL 3107 0.5% 1 Jun 17	2010-09-23	0,8	0,8	654 218 101	15 612 218 101	0	14 958 000 000
SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19	2015-02-09	2,8	2,8	175 023 804	20 799 023 804	-1 215 000 000	20 624 000 000
SGB IL 3102 4% 1 Dec 20	1996-06-03	4,3	4,0	9 936 932 685	44 181 982 685	595 000 000	34 245 050 000
SGB IL 3108 0.25% 1 Jun 22	2011-09-15	5,8	5,8	463 512 404	29 664 512 404	100 000 000	29 201 000 000
SGB IL 3109 1% 1 Jun 25	2014-02-11	8,8	8,5	139 836 219	21 879 836 219	136 000 000	21 740 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	2016-02-15	9,8	9,8	95 343 190	12 201 343 190	78 000 000	12 106 000 000
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	1998-06-23	12,4	10,6	870 514	3 870 514	0	3 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	1999-04-19	12,4	10,6	7 310 353 981	38 514 643 981	-245 000 000	31 204 290 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	2015-04-30	15,9	15,7	129 244 122	7 470 244 122	-40 000 000	7 341 000 000
		7,0	6,9	18 905 335 020	190 327 675 020	-591 000 000	171 422 340 000

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	0,1	0,1	2 000 000 000	17 069 000 000	0	14 223 000 000
EUB USD 1% 15 Nov 16	2013-08-30	0,3	0,3	3 000 000 000	25 603 500 000	0	19 541 100 000
EUB USD 0.75% 12 Apr 17	2014-03-25	0,7	0,7	2 000 000 000	17 069 000 000	0	12 660 600 000
EUB USD 0.875% 15 Aug 17	2014-05-28	1,0	1,0	1 500 000 000	12 801 750 000	0	9 863 025 000
EUB USD 1% 13 Nov 17	2014-11-13	1,3	1,3	3 000 000 000	25 603 500 000	0	22 146 600 000
EUB USD 0.875% 23 Jan 18	2015-01-23	1,5	1,5	2 500 000 000	21 336 250 000	0	20 280 125 000
EUB USD 1% 27 Feb 18	2013-02-27	1,6	1,6	3 000 000 000	25 603 500 000	0	18 877 500 000
EUB USD 1.125% 15 May 18	2015-05-13	1,8	1,8	2 250 000 000	19 202 625 000	0	18 447 975 000
EUB USD 1% 5 Oct 18	2015-10-05	2,2	2,2	1 000 000 000	8 534 500 000	0	8 420 700 000
EUB USD 1,125% 15 Mar 19	2016-03-15	2,6	2,6	2 000 000 000	17 069 000 000	0	16 938 600 000
EUB USD 1,625% 24 Mar 20	2015-03-24	3,7	3,6	2 000 000 000	17 069 000 000	0	17 267 112 500
EUB EUR 0,25% 27 Nov 16	2013-11-27	0,3	0,3	1 000 000 000	9 541 144 270	0	8 933 918 540
EUB EUR 0.13% 25 Jun 17	2014-06-25	0,9	0,9	500 000 000	4 770 572 135	0	4 500 720 290
EUB EUR 0.875% 31 Jan 18	2013-01-31	1,5	1,5	4 000 000 000	38 164 577 080	0	34 763 460 000
EUB EUR 0.75% 2 May 19	2014-05-02	2,8	2,7	2 250 000 000	21 467 574 608	0	20 402 744 918
EUB EUR 0.05% 12 Feb 20	2015-02-12	3,5	3,5	1 500 000 000	14 311 716 405	0	14 156 448 840
ESB EUR 9.405% 28 Dec 26	1996-04-09	10,4	7,8	60 101 210	573 434 315	0	534 099 996
		1,6	1,6		295 790 643 813	0	261 957 730 084

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	0,6	0,6	1 500 000 000	12 801 750 000	0	12 612 250 000
Privatplaceringar, utländsk valuta	0,6	0,6		12 801 750 000	0	12 612 250 000
	0,6	0,6		12 801 750 000	0	12 612 250 000

Summa: Kapitalmarknad

-53 829 900 000 1 042 998 945 084

PENNINGMARKNAD

Statsskuldväxlar

Statsskuldväxel	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
STB 20 Jul 16	2016-04-08	-	-	-15 000 000 000	0
STB 17 Aug 16	2016-05-06	0,1	0,0	0	25 000 000 000
STB 21 Sep 16	2016-03-11	0,1	0,1	0	65 000 000 000
STB 19 Oct 16	2016-07-01	0,2	0,2	0	10 000 000 000
STB 21 Dec 16	2016-06-03	0,4	0,4	0	17 500 000 000
		0,2	0,2	-15 000 000 000	117 500 000 000

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	144 278	-273 527
Bankkonton, utländsk valuta	1 075 296 979	404 935 176	152 190 674
Banklån mm	17 630 000 000	-219 000 000	17 630 000 000
Banklån, konton mm	18 705 296 979	186 079 454	17 781 917 146
Repor, Reala statsobligationer	579 871 420	6 502 086 172	-363 136 711
Repor, Statsobligationer	36 061 629 851	11 462 792 569	36 061 629 851
Repor, Statsskuldväxlar	269 402 623	-626 992 745	-626 992 745
Repor, svenska statspapper	36 910 903 894	17 337 885 996	35 071 500 395
Riksbankscertifikat, innehav	0	37 000 000 000	0
Värdepappersinnehav	0	37 000 000 000	0
	55 616 200 873	54 523 965 450	52 853 417 541

Säkerheter

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Credit Support Annex till ISDA, SEK	7 586 400 000	-321 000 000	7 586 400 000
Credit Support Annex till ISDA, utländsk valuta	9 089 848 146	-1 055 458 454	9 089 848 146
Marginalsäkerheter, Futures	0	-12 068 749	-125 327 262
Säkerheter under central motpartsclearing	7 000 245 302	388 105 387	5 064 614 124
	23 676 493 448	-1 000 421 816	21 615 535 008

Summa: Penningmarknad

38 523 543 634 191 968 952 550

PRIVATMARKNAD

Premieobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utgivet	Behållet	Förändring	Nominellt belopp, kr
SLB 2015:1 0.1% 19 Apr 17	2015-05-13	0,7	0,7	1 300 000 000	-82 975 000	0	1 217 025 000
SLB 2012:1 0.8% 19 Apr 17	2012-04-30	0,7	0,7	2 000 000 000	-61 735 000	0	1 938 265 000
SLB 2015:2 0.1% 1 Nov 17	2015-11-27	1,3	1,2	1 500 000 000	-95 100 000	0	1 404 900 000
SLB 2013:1 0.7% 16 Maj 18	2013-05-22	1,8	1,8	2 100 000 000	-67 040 000	0	2 032 960 000
SLB 2016:1 0.1% 16 Maj 18	2016-05-09	1,8	1,8	1 400 000 000	-5 485 000	0	1 394 515 000
SLB 2013:2 1.0% 13 Nov 18	2013-11-12	2,3	2,2	2 100 000 000	-29 175 000	0	2 070 825 000
SLB 2014:1 0.8% 7 Maj 19	2014-04-30	2,8	2,7	2 100 000 000	-63 635 000	0	2 036 365 000
SLB 2014:2 0.6% 2 Dec 21	2014-11-26	5,3	5,2	2 900 000 000	-10 515 000	0	2 889 485 000
		2,4	2,4	15 400 000 000	-415 660 000	0	14 984 340 000

Riksgäldsspar

Kontoform	Förändring	Nominellt belopp, kr
Riksgäldsspar, nominellt	-8 779 123	262 681 985
Riksgäldsspar, reallt	-7 383 848	125 643 608
	-16 162 971	388 325 593

Summa: Privatmarknad

-16 162 971 15 372 665 593

ALLA MARKNADER INKL. FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

Förändring Nominellt belopp

Summa nominella belopp. Under A på sidan 1.

-15 322 519 337 1 250 340 563 226

APPENDIX

Olika skuldslag, inklusive vidareutlåning och förvaltningsstillgångar

Skuldslag	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs och uppräkningsbelopp	Löptid	Duration	Andel
Nominell kronskuld	711 374 227 749	711 124 227 749	5,28	4,73	67,4
Real kronskuld	171 547 983 608	190 453 318 628	7,02	6,93	18,1
Valutaskuld	151 343 483 704	153 388 854 755	1,54	0,24	14,5
	1 034 265 695 061	1 054 966 401 131	4,59	4,60	100,0

Nominell kronskuld, inklusive förvaltningsstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr
Statsobligationer	597 006 625 000
Statsskuldväxlar	117 500 000 000
Likviditetsförvaltning	52 701 226 868
Valutaterminer, SEK	31 168 277 933
Privatmarknad	15 247 021 985
Säkerheter	12 651 075 963
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	-114 900 000 000
	711 374 227 749

Real kronskuld

Instrument	Nominellt belopp, kr	Inflationskompensation, kr	Real kronskuld, kr
Reala statsobligationer	171 422 340 000	18 905 335 020	190 327 675 020
Riksgäldsspar, reall	125 643 608	0	125 643 608
	171 547 983 608	18 905 335 020	190 453 318 628

Valutaskuld, inkl. vidareutlåning och penningmarknadstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr	Valutakurseffekter, kr	Valutaskuld, kr
Publika obligationer, utländsk valuta	261 423 630 088	33 793 579 410	295 217 209 498
Swappar mellan SEK och utländsk valuta	114 900 000 000	3 544 235 457	118 444 235 457
Övriga valutaskulder	13 146 349 996	695 142 220	13 841 492 216
Säkerheter	8 964 459 046	-0	8 964 459 046
Likviditetsförvaltning	152 190 674	-0	152 190 674
Valutaterminer, SEK	-31 168 277 933	-956 170 655	-32 124 448 588
Vidareutlåning	-216 074 868 166	-35 031 415 382	-251 106 283 547
	151 343 483 704	2 045 371 050	153 388 854 755

Valutaskuld exklusive vidareutlåning	367 418 351 870	37 076 786 432	404 495 138 302
--------------------------------------	-----------------	----------------	-----------------

Swappar, nominellt nettobelopp med fast ränta i kronor

Förfalloår	Ränteswappar i kronor, kr	Ränteswappar mellan kronor och utländska valutor, kr	Ränteswappar totalt, kr
2016	6 750 000 000	13 000 000 000	19 750 000 000
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	5 950 000 000	5 000 000 000	10 950 000 000
2024	3 250 000 000	2 500 000 000	5 750 000 000
2025	3 000 000 000	0	3 000 000 000
2026	1 050 000 000	0	1 050 000 000
	131 350 000 000	111 350 000 000	242 700 000 000

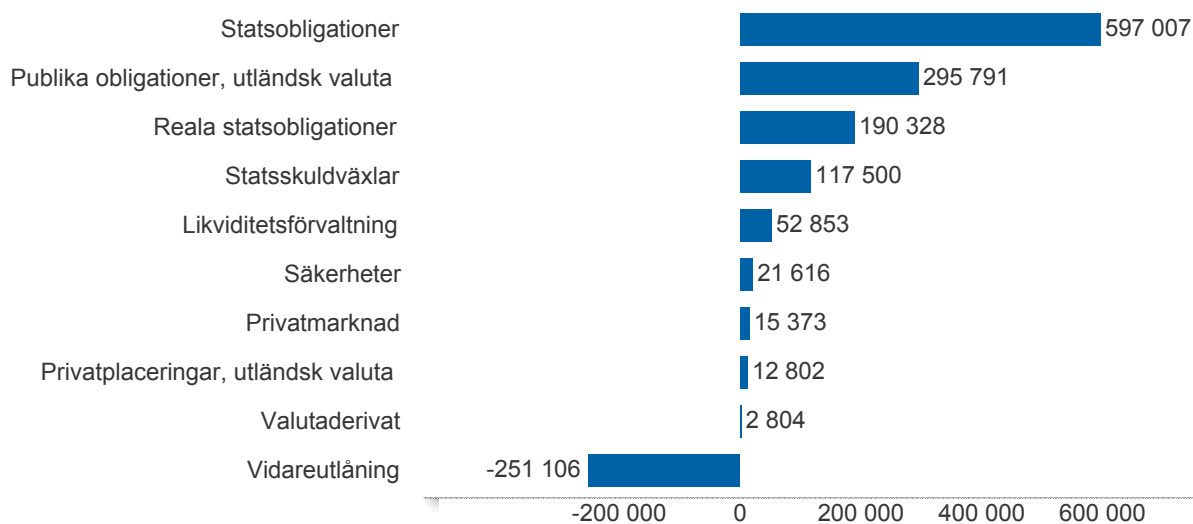
Skulder och tillgångar i likviditetsförvaltning och betalning av säkerheter

Instrument	Nominellt belopp	Bruttoskuld	Tillgångar	Aktuell valutakurs
Banklån, konton mm	17 781 917 146	18 705 296 979	-923 379 833	-923 379 833
Credit Support Annex till ISDA	16 676 248 146	16 676 248 146	0	0
Marginalsäkerheter, Futures	-125 327 262	0	-125 327 262	-125 327 262
Repor, svenska statspapper	35 071 500 395	36 910 903 894	-1 839 403 499	-1 839 403 499
Säkerheter under central motpartsclearing	5 064 614 124	7 000 245 302	-1 935 631 178	-1 935 631 178
	74 468 952 550	79 292 694 321	-4 823 741 772	-4 823 741 772

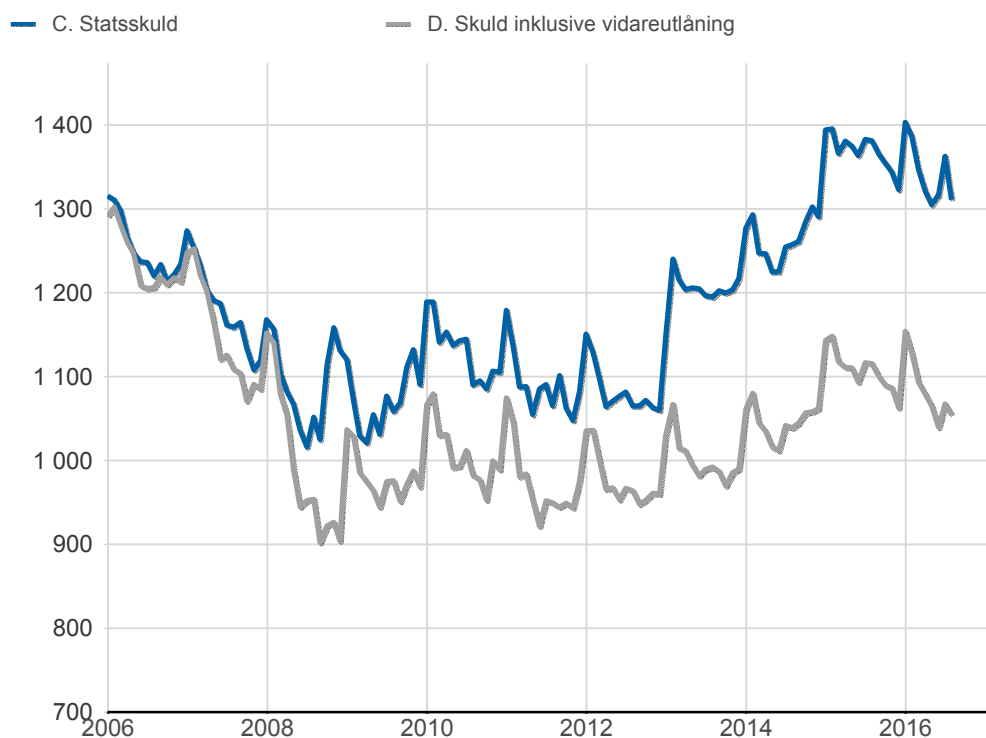
Översikt av statens skuld, mnkr

	A. Nominellt belopp	B. Aktuella valutakurser	Andel %	Löptid år	Duration år	C. Stats-skuld	D. Inkl. vidareutlåning	Andel %	D. Marknads-värde
Statsobligationer	597 007	597 007	45,7	6,9	6,4	597 007	597 007	56,6	721 232
Reala statsobligationer	171 422	190 328	14,6	7,0	6,9	190 328	190 328	18,0	241 393
Publika obligationer, utländsk valuta	261 958	295 791	22,6	1,6	1,6	295 791	295 791	28,0	299 351
Privatplacering, utländsk valuta	12 612	12 802	1,0	0,6	0,6	12 802	12 802	1,2	12 837
Kapitalmarknad	1 042 999	1 095 927	83,9	5,4	5,3	1 095 927	1 095 927	103,9	1 274 813
Statsskuldväxlar	117 500	117 500	9,0	0,2	0,2	117 500	117 500	11,1	117 652
Säkerheter	21 616	21 616	1,7	0,0	0,0	23 676	21 616	2,0	21 733
Likviditetsförvaltning	52 853	52 853	4,0	0,0	0,0	55 616	52 853	5,0	52 853
Penningmarknad	191 969	191 969	14,7	0,1	0,1	196 793	191 969	18,2	192 238
Premieobligationer	14 984	14 984	1,1	2,4	2,4	14 984	14 984	1,4	15 432
Riksgäldsspar	388	388	0,0	1,4	1,4	388	388	0,0	392
Privatmarknad	15 373	15 373	1,2	2,4	2,4	15 373	15 373	1,5	15 824
Valutaderivat	0	2 804	0,2	-	33,0	2 804	2 804	0,3	-10 454
Räntederivat	0	0	0,0	-	42,7	0	0	0,0	-15 062
Derivatmarknad	0	2 804	0,2	-	38,7	2 804	2 804	0,3	-25 517
Vidareutlåning	0	0	0,0	-	-	0	-251 106	-23,8	0
	1 250 341	1 306 073	100,0	4,6	4,0	1 310 896	1 054 966	100,0	1 457 359

D. Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mnkr

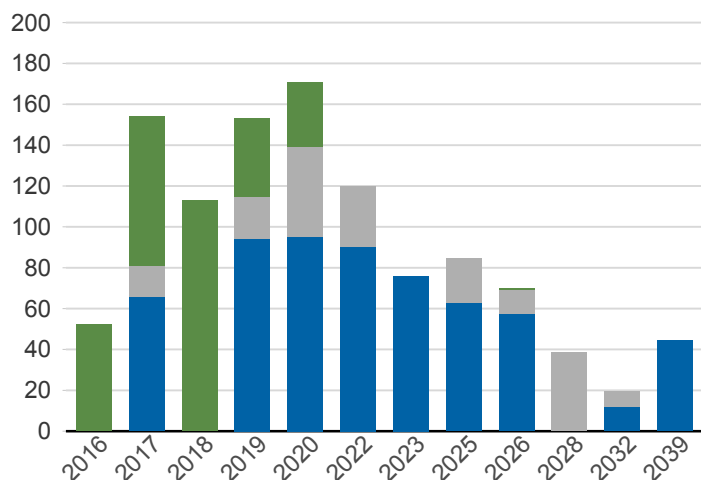


Statsskuld och Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningsstillgångar, mdkr



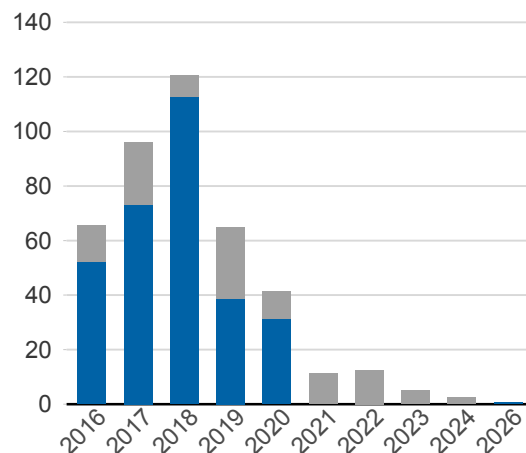
Kapitalmarknadsförfall, uppräknade belopp till aktuella valutakurser, mdkr

Obligationer, utländsk valuta Statsobligationer
 Reala statsobligationer

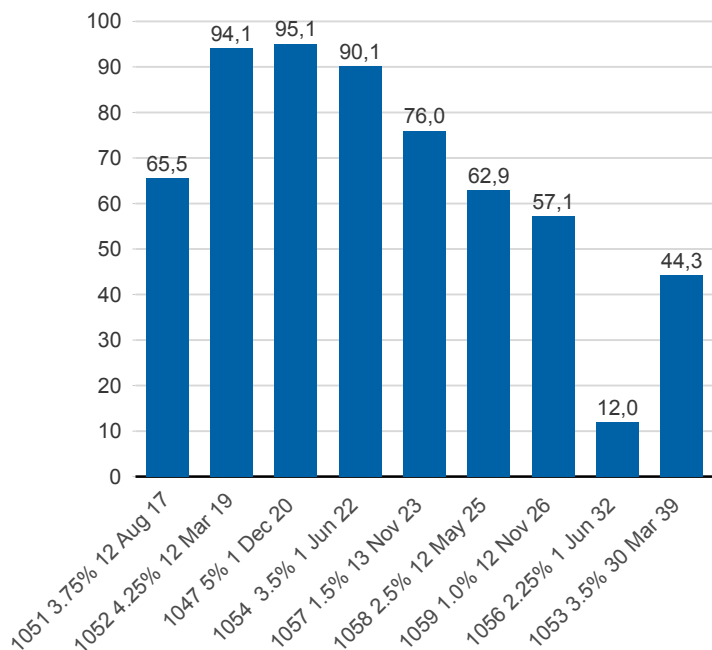


Valutaskuld på kapitalmarknaden inklusive swappar, aktuell valutakurs, mdkr

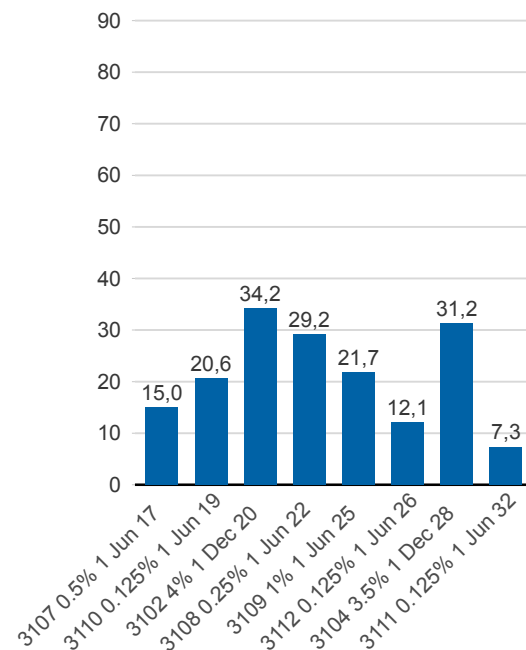
Ränteswappar mellan SEK och utländska valutor
 Obligationer i utländsk valuta



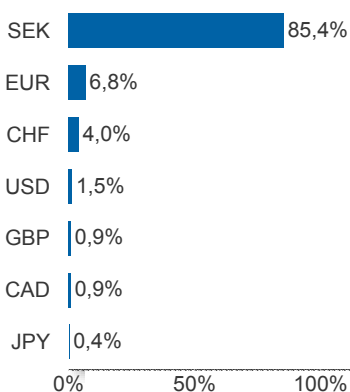
Statsobligationer, nominellt, mdkr



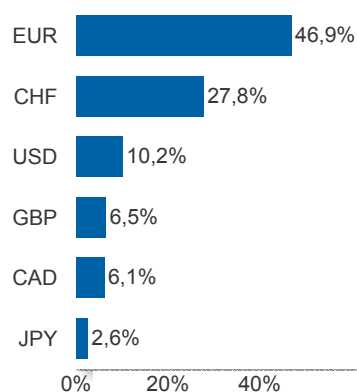
Reala statsobligationer, nominellt, mdkr



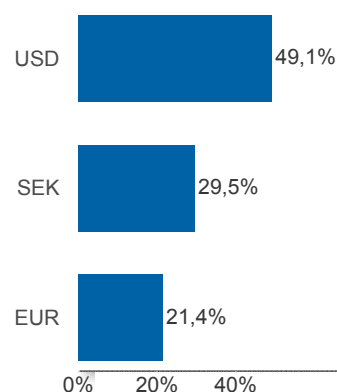
Valutaexponering, skulder och fordringar i vidareutlåningen, netto, %



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

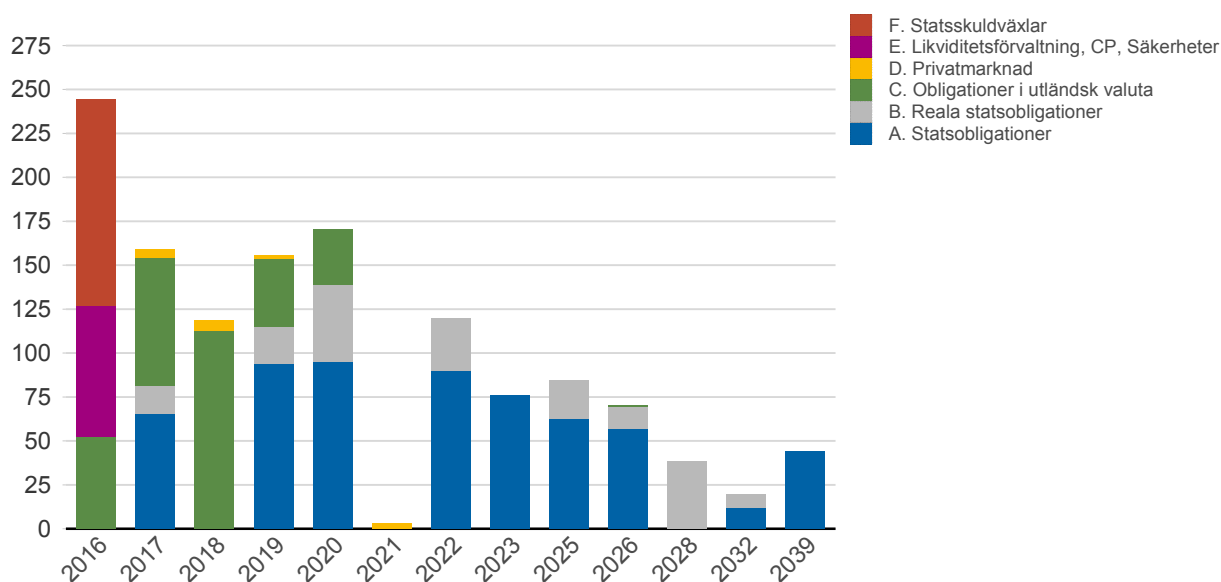


Finansiering av valutaskulden, inklusive finansiering av vidareutlåningen, brutto, %



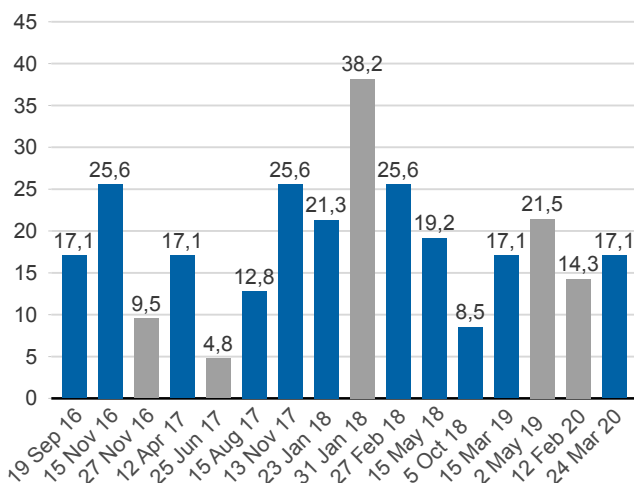
Anm: Finansieringen i SEK avser kronskuld som i kombination med swappar ger exponering i utländsk valuta.

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



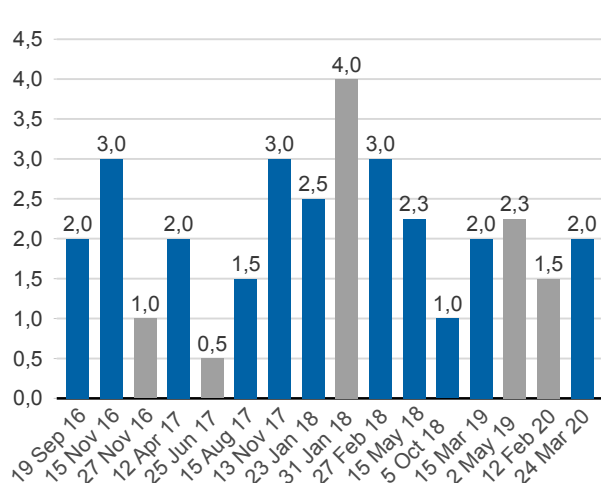
Publ. obligationer i euro och dollar, aktuell valutakurs, mdkr

■ EUR ■ USD



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

■ EUR ■ USD



Vidareutlåning

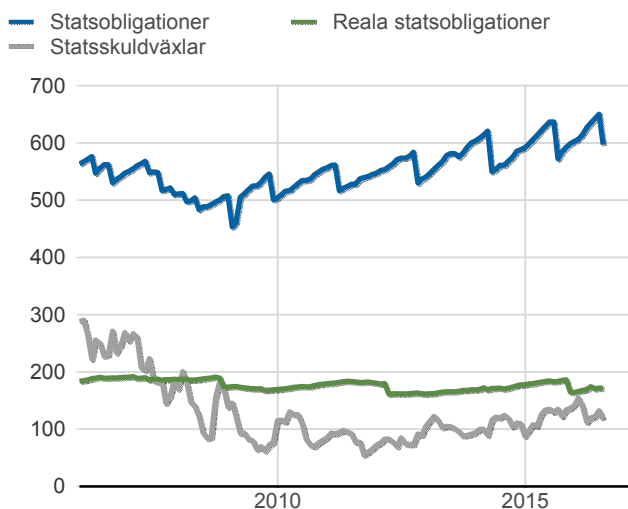
Mottagare	EUR	USD	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs
Vidareutlåning till Irland	600 000 000	0	5 242 515 794	5 724 686 562
Vidareutlåning till Riksbanken, kapitalmarknad	5 500 000 000	22 603 000 000	210 832 352 372	245 381 596 985
	6 100 000 000	22 603 000 000	216 074 868 166	251 106 283 547

Vidareutlåning till Riksbanken, förfall

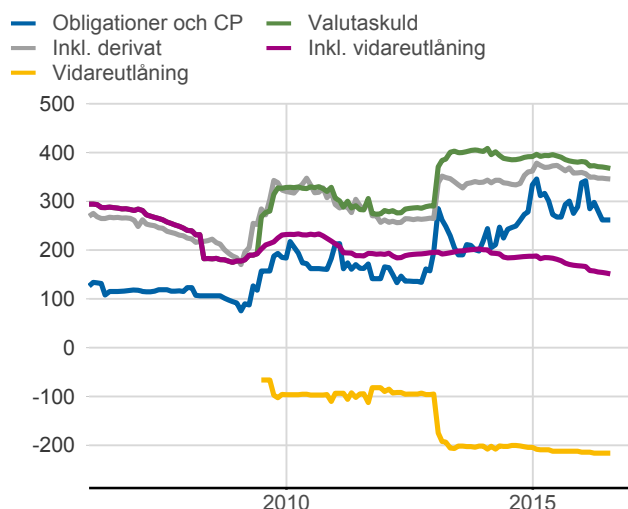
Aktuell valutakurs, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
	0	245 381 596 985	245 381 596 985
Nominellt belopp, kr	Penningmarknad	Kapitalmarknad	Belopp, kr
2016-09-19	0	14 223 000 000	14 223 000 000
2016-11-15	0	19 541 100 000	19 541 100 000
2016-11-27	0	8 933 918 532	8 933 918 532
2017-04-12	0	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
	0	210 832 352 372	210 832 352 372

Förfalldatum	Dollar	Euro
Nominellt belopp, respektive valuta		
2016-09-19	2 000 000 000	0
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
	22 603 000 000	5 500 000 000

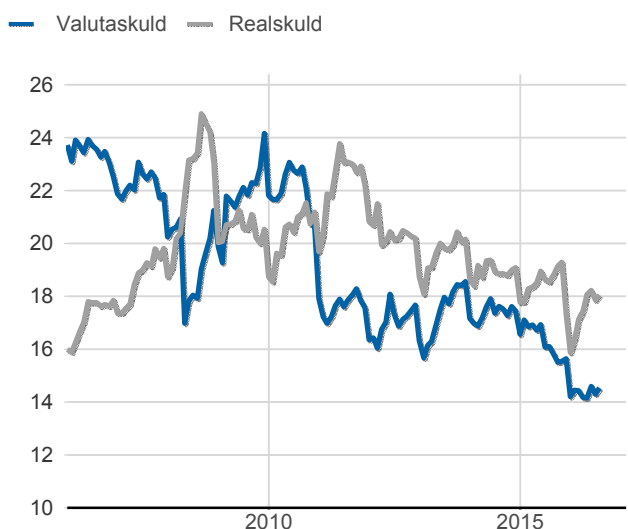
Statsobligationer, reaala statsobligationer och statsskuldväxlar, nominella belopp, mdkr



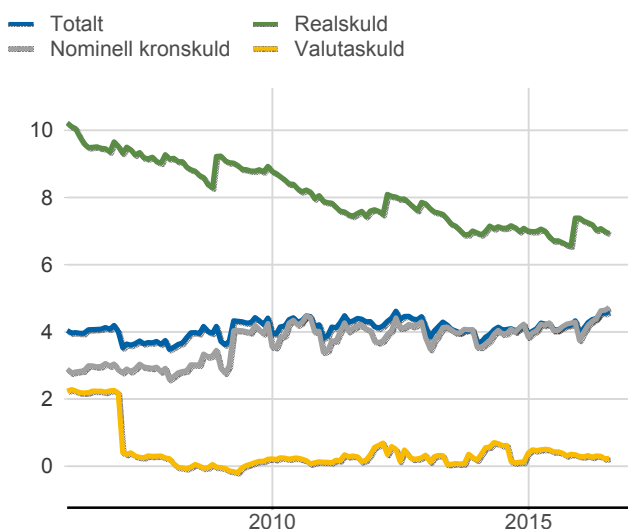
Valutaskuld inkl. vidareutlåning uppdelat på instrument, nominella belopp, mdkr



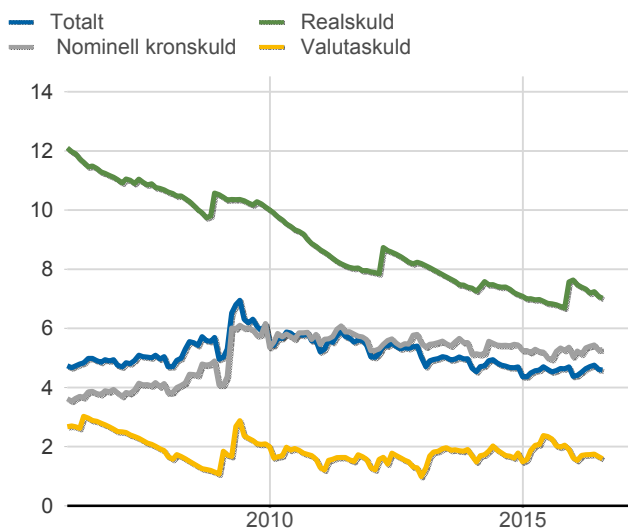
Skuldandelar, inklusive vidareutlåning, procent



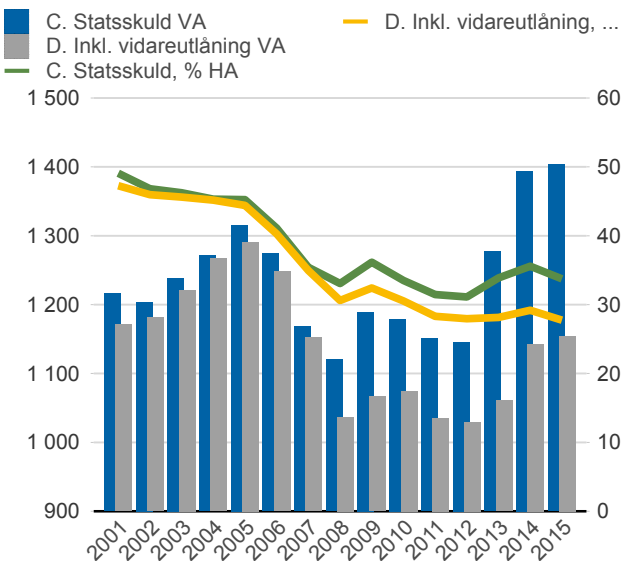
Duration för den totala skulden och respektive skuldslag, inkl. vidareutlåning, år



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.

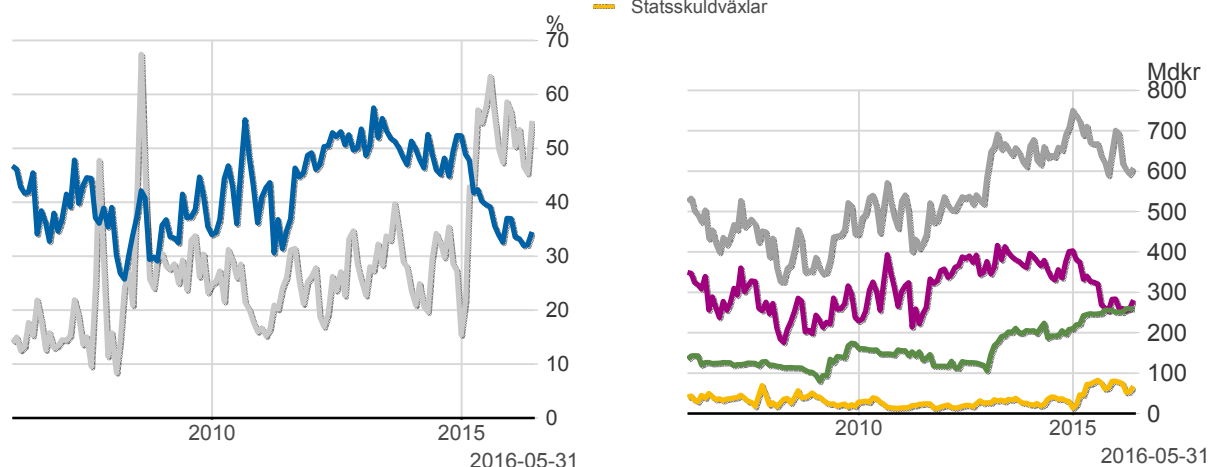
Finansiering av statens skuld, inklusive och exklusive finansiering av vidareutlåning, nominellt belopp, kr

Valuta	Instrument	Nominellt belopp	Procent	Exklusive vidareutlåning	Procent	Vidareutlåning
Kronor	Statsobligationer	597 006 625 000	47,7	591 764 109 207	57,2	5 242 515 794
	Reala statsobligationer	171 419 340 000	13,7	171 419 340 000	16,6	0
	Statsskuldväxlar	117 500 000 000	9,4	117 500 000 000	11,4	0
	Likviditetsförvaltning	52 701 226 868	4,2	52 701 226 868	5,1	0
	Säkerheter	12 651 075 963	1,0	12 651 075 963	1,2	0
	Premieobligationer	14 984 340 000	1,2	14 984 340 000	1,4	0
	Riksgäldsspar	388 325 593	0,0	388 325 593	0,0	0
	Övriga kapitalmarknadsskulder	3 000 000	0,0	3 000 000	0,0	0
			966 653 933 423	77,3	961 411 417 630	93,0
Utländsk valuta	Obligationer i utländsk valuta	274 569 980 084	22,0	63 737 627 712	6,2	210 832 352 372
	Likviditetsförvaltning	152 190 674	0,0	152 190 674	0,0	0
	Säkerheter	8 964 459 046	0,7	8 964 459 046	0,9	0
			283 686 629 803	22,7	72 854 277 431	7,0
		1 250 340 563 226	100,0	1 034 265 695 061	100,0	216 074 868 166

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	Förfalldag	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	94 050 120 000
	SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	1053	SEK	SE0002829192	-	3,5	2009-03-30	2039-03-30	30,0	44 250 450 000
	SGB 1054 3.5% 1 Jun 22	1054	SEK	SE0003784461	-	3,5	2011-02-09	2022-06-01	11,3	90 130 500 000
	SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	1056	SEK	SE0004517290	-	2,25	2012-03-20	2032-06-01	20,2	12 000 000 000
	SGB 1057 1.5% 13 Nov 23	1057	SEK	SE0004869071	-	1,5	2012-10-22	2023-11-13	11,1	75 977 000 000
	SGB 1058 2.5% 12 May 25	1058	SEK	SE0005676608	-	2,5	2014-02-03	2025-05-12	11,3	62 872 000 000
	SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	1059	SEK	SE0007125927	-	1	2015-05-22	2026-11-12	11,5	57 147 000 000
	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	31 204 290 000
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	29 201 000 000
SGB IL 3109 1% 1 Jun 25		3109	SEK	SE0005703550	-	1	2014-02-11	2025-06-01	11,3	21 740 000 000
SGB IL 3110 0.125% 1 Jun 19		3110	SEK	SE0006758736	-	0,125	2015-02-09	2019-06-01	4,3	20 624 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32		3111	SEK	SE0007045745	-	0,125	2015-04-30	2032-06-01	17,1	7 341 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26		3112	SEK	SE0008014062	-	0,125	2016-02-15	2026-06-01	10,3	12 106 000 000
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 0.625% 19 Sep 16		USD	XS1111084809	US87020DAP96	0,625	2014-09-19	2016-09-19	2,0	2 000 000 000
	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
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.

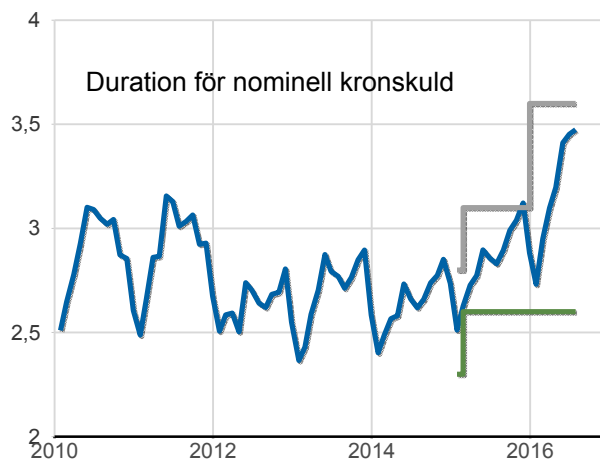
Andelar och löptid (duration) i Riksgäldens riskstyrning

	Statsskulden	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt	Skuldmått riskstyrning	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt
Nominell kronskuld	714 899 474 114	54,9	4,83	711 124 227 749	66,9	3,47
Real kronskuld	190 453 318 628	14,4	6,95	190 453 318 628	18,4	6,95
Valutaskuld	405 543 633 708	30,7	0,23	153 391 384 240	14,7	0,15
	1 310 896 426 450	100,0	4,67	1 054 968 930 617	100,0	3,77

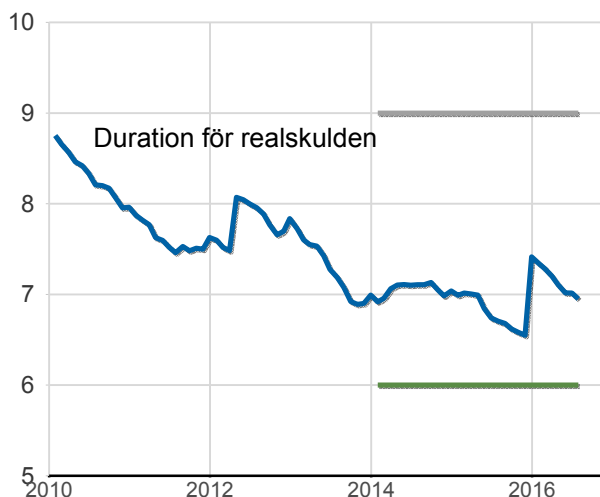
Löptid (duration), år, månadsgenomsnitt

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



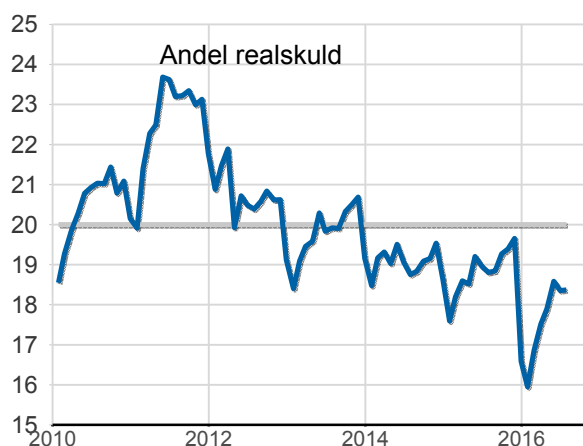
— Övre riktvärdet, år
— Undre riktvärdet, år
— Realskuld, år



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

