

Sveriges statsskuld

30 september 2024

STATSSKULD

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
A. Nominellt belopp, inkl. förvaltningstillgångar	29 426 594 023	967 626 663 653
Upplupen inflationskompensation (uppräkningsbelopp)	434 850 548	64 906 524 308
Valutakurseffekter	-487 913 157	-197 192 344
B. Nominellt uppräknat belopp till aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar	29 373 531 413	1 032 335 995 617
Förvaltningstillgångar, aktuell valutakurs	1 012 299 955	5 194 349 806
Officiellt mått på statens bruttoskuld:		
C. STATSSKULD	30 385 831 368	1 037 530 345 423

STATENS SKULD INKL. VIDAREUTLÅNING OCH FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

	Förändring från föregående månad	Utestående belopp, kr
Vidareutlåning	-45 369 361	-4 101 414 221
Förvaltningstillgångar	-1 012 299 955	-5 194 349 806
D. Statens skuld inklusive vidareutlåning och förvaltningstillgångar	29 328 162 052	1 028 234 581 396

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 1058 2.5% 12 May 25	2014-02-03	0,6	0,6		0	83 126 000 000
SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	2015-05-22	2,1	2,1		3 750 000 000	87 664 000 000
SGB 1060 0.75% 12 May 28	2017-01-27	3,6	3,6		0	75 013 000 000
SGB 1061 0.75% 12 Nov 29	2018-06-01	5,1	5,0		1 000 000 000	76 339 000 000
SGB 1062 0.125% 12 May 31	2020-03-27	6,6	6,6		0	57 140 000 000
SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	2012-03-20	7,7	7,1		0	48 669 000 000
SGB 1065 1,75% 11 Nov 33	2022-05-06	9,1	8,4		0	58 122 000 000
SGB 1066 2.25% 11 May 35	2024-02-02	10,6	9,5		3 000 000 000	24 250 000 000
SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	2009-03-30	14,5	11,7		0	43 105 450 000
SGB 1063 0.5% 24 Nov 45	2020-11-24	21,2	19,8		250 000 000	18 222 000 000
SGB 1064 1,375% 23 Jun 71	2021-06-23	46,8	32,0		0	10 000 000 000
		6,7	5,9		8 000 000 000	581 650 450 000

Reala statsobligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Inflationskompensation	Inkl. inflationskomp.	Förändring	Nominellt belopp, kr
SGB IL 3109 1.0% 1 Jun 25	2014-02-11	0,7	0,7	10 722 701 889	43 772 701 889	0	33 050 000 000
SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	2016-02-15	1,7	1,7	11 000 214 107	44 708 214 107	0	33 708 000 000
SGB IL 3113 0.125% 1 Dec 27	2017-02-06	3,2	3,2	9 004 393 855	38 220 393 855	0	29 216 000 000
SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	1999-04-22	4,2	3,9	17 477 319 650	45 473 609 650	0	27 996 290 000
SGB IL 3103 3.5% 1 Dec 28	1998-06-26	4,2	3,9	697 832	1 697 832	0	1 000 000
SGB IL 3114 0.125% 1 Jun 30	2020-02-10	5,7	5,6	5 559 792 262	29 000 792 262	250 000 000	23 441 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32	2015-04-30	7,7	7,6	9 186 873 361	36 275 373 361	500 000 000	27 088 500 000
SGB IL 3115 0.125% 1 Jun 39	2021-09-06	14,7	14,5	1 954 531 353	10 871 031 353	250 000 000	8 916 500 000
		4,1	4,0	64 906 524 308	248 323 814 308	1 000 000 000	183 417 290 000

Gröna obligationer

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration		Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB G SEK 0.125% 9 Sep 30	2020-09-09	5,9	5,9		0	20 000 000 000
		5,9	5,9		0	20 000 000 000

Publika obligationer i utländsk valuta

Obligation	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Utländsk valuta	Aktuell valutakurs	Förändring	Nominellt belopp, kr
EUB USD 4.375% 30 Jan 26	2024-01-30	1,3	1,3	2 000 000 000	20 261 300 000	0	20 902 400 000
ESB EUR 9.405% 28 Dec 26	1996-04-09	2,2	2,1	33 205 918	375 470 103	0	295 090 240
		1,4	1,4		20 636 770 103	0	21 197 490 240

Privatplaceringar i utländsk valuta m.m.

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

Summa: Kapitalmarknad

9 000 000 000

806 265 230 240

PENNINGMARKNAD

Statsskuldväxlar

Statsskuldväxel	Utgivningsdag	Löptid	Duration	Förändring	Nominellt belopp, kr
STB 18 Sep 24	2023-09-08	-	-	-35 000 000 000	0
STB 16 Oct 24	2024-07-05	0,0	0,0	0	5 000 000 000
STB 20 Nov 24	2024-08-09	0,1	0,1	0	12 500 000 000
STB 18 Dec 24	2023-12-01	0,2	0,2	0	15 000 000 000
STB 19 Mar 25	2024-03-08	0,5	0,5	0	7 500 000 000
STB 18 Jun 25	2024-06-14	0,7	0,7	5 000 000 000	12 500 000 000
STB 17 Sep 25	2024-09-06	1,0	1,0	7 500 000 000	7 500 000 000
		0,4	0,4	-22 500 000 000	60 000 000 000

Likviditetsförvaltningsinstrument

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Bankkonton, kronor	0	-752 131	-469 708
Bankkonton, utländsk valuta	4	-2 258 339	-282 022
Banklån mm	34 550 000 000	8 277 000 000	34 550 000 000
Interimspost, bankkonton kronor	0	752 131	469 502
Interimspost, bankkonton utländsk valuta	10 072 707	-40 638 484	9 717 117
Interimspost, konton i Riksbanken	9 530 731 675	4 588 413 616	9 530 731 675
Banklån, konton mm	44 090 804 386	12 822 516 793	44 090 166 564
Commercial paper, utländsk valuta	53 511 806 455	26 932 254 664	53 511 806 455
Commercial paper, utländsk valuta	53 511 806 455	26 932 254 664	53 511 806 455
Repor, Reala statsobligationer	0	1 605 521 675	-373 269 341
Repor, Statsobligationer	7 829 412 017	150 416 958	4 719 909 645
Repor, Statsskuldväxlar	646 995 158	646 995 158	646 995 158
Repor, svenska statspapper	8 476 407 175	2 402 933 791	4 993 635 462
	106 079 018 016	42 157 705 248	102 595 608 481

Anm: Saldon på bankkonton redovisas likviddagsmässigt. Interimsposten innehåller belopp på väg till eller från bankkontot som ännu inte betalats och därför ligger på så kallade avräkningskonton i Riksgäldens redovisning. Det är summan av bankkontots saldo och interimsposten som avgör om en bankkontobehållning klassas som skuld eller tillgång.

Säkerheter

Instrument	Bruttoskuld, kr	Förändring	Nominellt belopp, kr
Credit Support Annex till ISDA, SEK	154 000 000	-259 400 000	-603 600 000
Credit Support Annex till ISDA, utländsk valuta	269 905 848	938 072 159	-185 327 057
Marginalsäkerheter, Futures	0	-2 548 599	-89 467 487
Säkerheter under central motpartsclearing	53 407 628	93 011 695	-355 232 253
	477 313 476	769 135 255	-1 233 626 796

Anm: Saldon på bankkonton redovisas likviddagsmässigt. Interimsposten innehåller belopp på väg till eller från bankkontot som ännu inte betalats och därför ligger på så kallade avräkningskonton i Riksgäldens redovisning. Det är summan av bankkontots saldo och interimsposten som avgör om en bankkontobehållning klassas som skuld eller tillgång.

Summa: Penningmarknad

20 426 840 503 161 361 981 685

ALLA MARKNADER INKL. FÖRVALTNINGSTILLGÅNGAR

Förändring

Nominellt belopp

Summa nominella belopp. Under A på sidan 1.

29 426 594 023

967 626 663 653

APPENDIX

Olika skuldslag, inklusive vidareutlåning och förvaltningstillgångar

Skuldslag	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs och uppräkningsbelopp	Löptid	Duration	Andel
Nominell kronskuld	723 204 194 773	723 204 194 773	5,72	4,85	70,3
Real kronskuld	183 417 290 000	248 323 814 308	4,14	3,99	24,2
Valutaskuld	56 903 764 659	56 706 572 315	0,57	0,14	5,5
	963 525 249 432	1 028 234 581 396	5,03	4,38	100,0

Nominell kronskuld, inklusive förvaltningstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr
Statsobligationer	581 650 450 000
Statsskuldväxlar	60 000 000 000
Likviditetsförvaltning	49 074 366 931
Gröna obligationer	20 000 000 000
Valutaterminer, SEK	13 438 210 094
Säkerheter	-958 832 253
	723 204 194 773

Real kronskuld

Instrument	Nominellt belopp, kr	Inflationskompensation, kr	Real kronskuld, kr
Reala statsobligationer	183 417 290 000	64 906 524 308	248 323 814 308
	183 417 290 000	64 906 524 308	248 323 814 308

Valutaskuld, inkl. vidareutlåning och penningmarknadstillgångar

Instrument	Nominellt belopp, kr	Valutakurseffekter, kr	Valutaskuld, kr
Likviditetsförvaltning	53 521 241 551	-80 478 955	53 440 762 596
Publika obligationer, utländsk valuta	21 197 490 240	-560 720 137	20 636 770 103
Övriga valutaskulder	-548 272	71 424 389	70 876 117
Säkerheter	-274 794 544	0	-274 794 544
Vidareutlåning	-4 101 414 221	0	-4 101 414 221
Valutaterminer, SEK	-13 438 210 094	372 582 359	-13 065 627 736
	56 903 764 659	-197 192 344	56 706 572 315

Valutaskuld exklusive vidareutlåning	61 005 178 880	-197 192 344	60 807 986 536
--------------------------------------	----------------	--------------	----------------

Swappar, nominellt belopp

Förfalloår	Ränteswappar i kronor, kr	Ränteswappar mellan kronor och utländska valutor, kr	Ränteswappar totalt, kr
2024	1 850 000 000	0	1 850 000 000
2025	11 650 000 000	0	11 650 000 000
2026	3 465 000 000	0	3 465 000 000
2027	1 600 000 000	0	1 600 000 000
2028	1 135 000 000	0	1 135 000 000
2029	1 800 000 000	0	1 800 000 000
2030	200 000 000	0	200 000 000
2032	1 850 000 000	0	1 850 000 000
2033	300 000 000	0	300 000 000
2034	100 000 000	0	100 000 000
	23 950 000 000	0	23 950 000 000

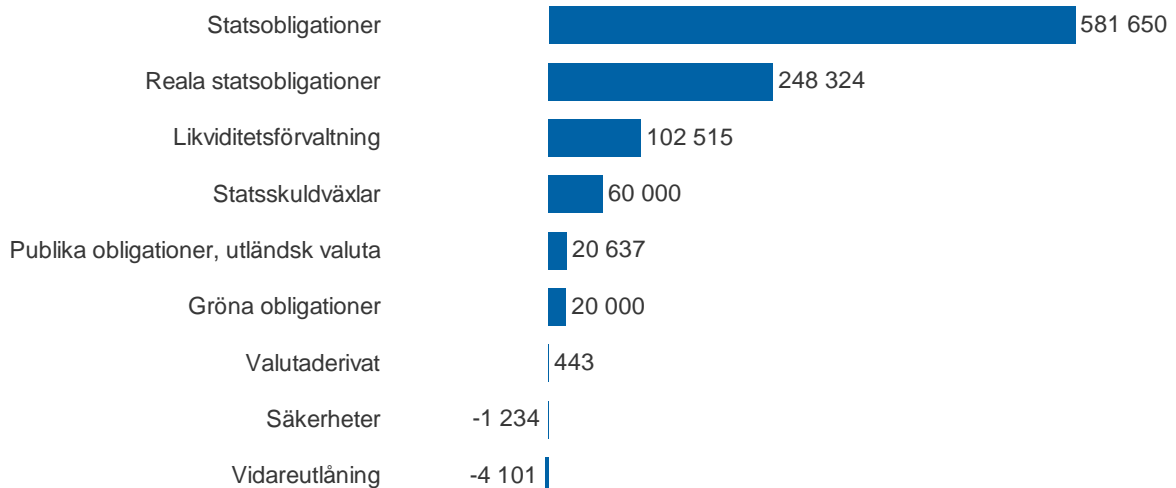
Skulder och tillgångar i likviditetsförvaltning och betalning av säkerheter

Instrument	Nominellt belopp	Bruttoskuld	Tillgångar	Aktuell valutakurs
Banklån, konton mm	44 090 166 564	44 090 804 386	-637 821	-637 821
Commercial paper, utländsk valuta	53 511 806 455	53 511 806 455	0	0
Credit Support Annex till ISDA	-788 927 057	423 905 848	-1 212 832 905	-1 212 832 905
Marginalsäkerheter, Futures	-89 467 487	0	-89 467 487	-89 467 487
Repor, svenska statspapper	4 993 635 462	8 476 407 175	-3 482 771 713	-3 482 771 713
Säkerheter under central motpartsclearing	-355 232 253	53 407 628	-408 639 881	-408 639 881
	101 361 981 685	106 556 331 491	-5 194 349 806	-5 194 349 806

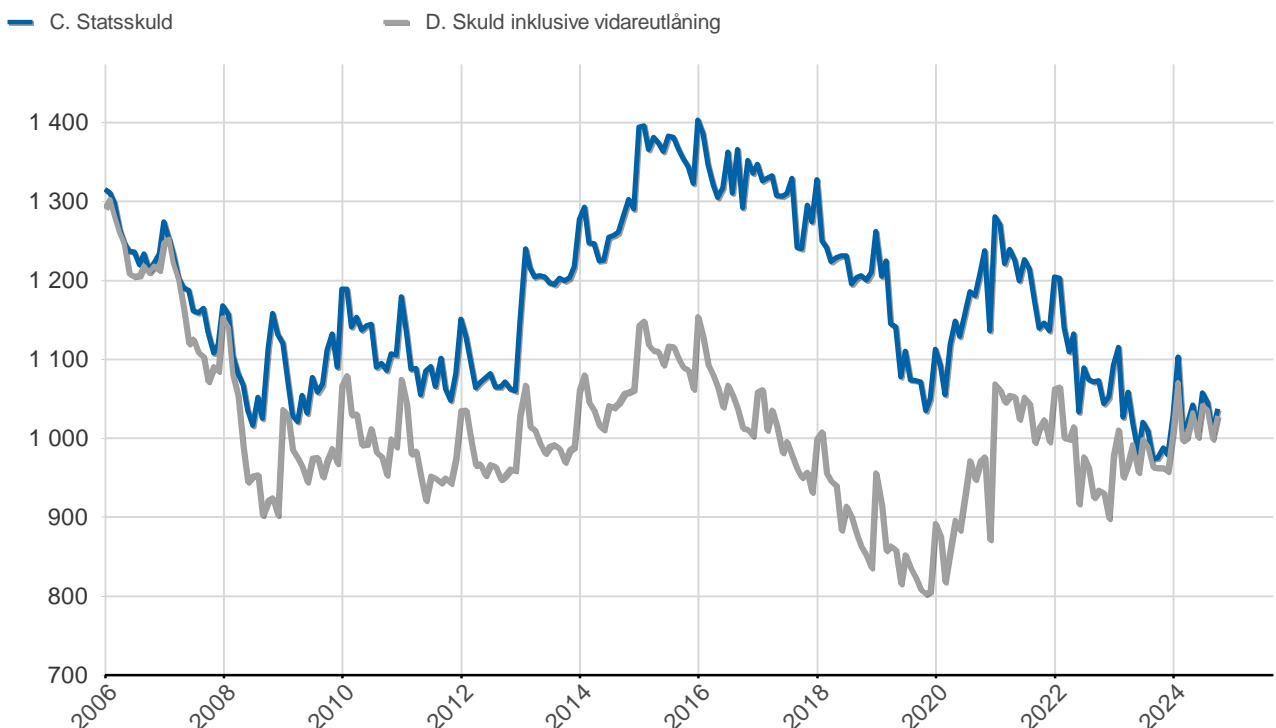
Översikt av statens skuld, mnkr

	A. Nominellt belopp	B. Aktuella valutakurser	Andel %	Löptid år	Duration år	C. Stats-skuld	D. Inkl. vidareutlåning	Andel %	D. Marknads-värde
Statsobligationer	581 650	581 650	56,3	6,7	5,9	581 650	581 650	56,6	573 830
Reala statsobligationer	183 417	248 324	24,1	4,1	4,0	248 324	248 324	24,2	251 391
Publika obligationer, utländsk valuta	21 197	20 637	2,0	1,4	1,4	20 637	20 637	2,0	21 048
Gröna obligationer	20 000	20 000	1,9	5,9	5,9	20 000	20 000	1,9	18 190
Kapitalmarknad	806 265	870 611	84,3	6,0	5,2	870 611	870 611	84,7	864 458
Statsskuldväxlar	60 000	60 000	5,8	0,4	0,4	60 000	60 000	5,8	59 398
Likviditetsförvaltning	102 596	102 515	9,9	0,1	0,1	105 999	102 515	10,0	101 907
Säkerheter	-1 234	-1 234	-0,1	0,0	0,0	477	-1 234	-0,1	-1 133
Penningmarknad	161 362	161 282	15,6	0,2	0,2	166 476	161 282	15,7	160 172
Valutaderivat	-1	443	0,0	-	-	443	443	0,0	728
Räntederivat	0	0	0,0	-	-	0	0	0,0	-104
Derivatmarknad	-1	443	0,0	-	-	443	443	0,0	624
Vidareutlåning	0	0	0,0	-	-	0	-4 101	-0,4	-4 128
Vidareutlåning	0	0	0,0	-	-	0	-4 101	-0,4	-4 128
	967 627	1 032 336	100,0	5,0	4,4	1 037 530	1 028 235	100,0	1 021 126

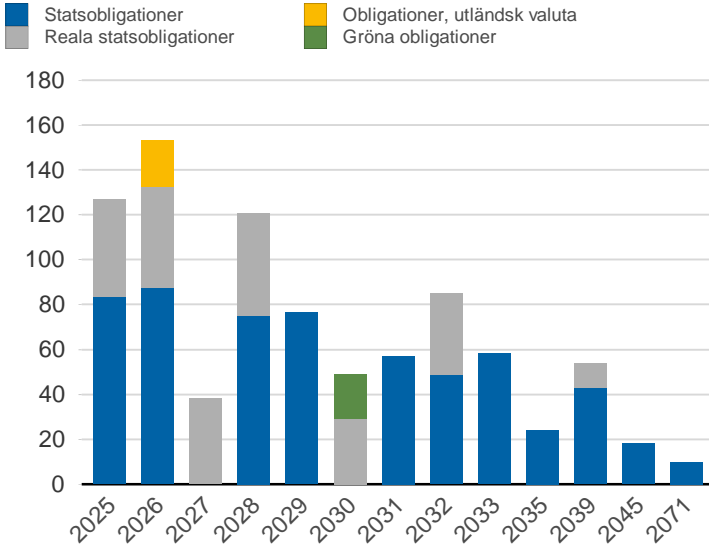
D. Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningstillgångar, mnkr



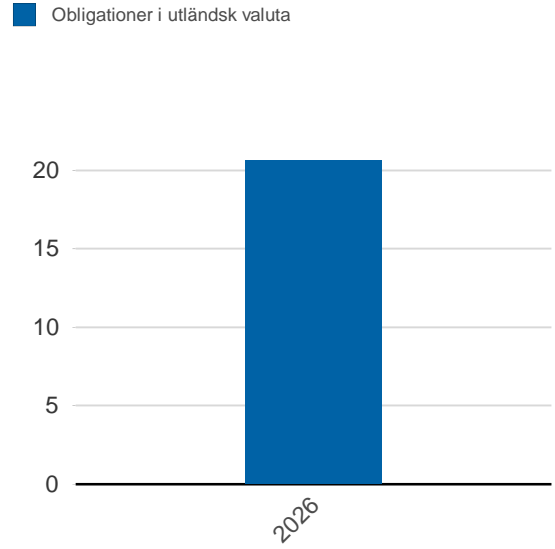
Statsskuld och Statens skuld inkl. vidareutlåning och förvaltningstillgångar, mdkr



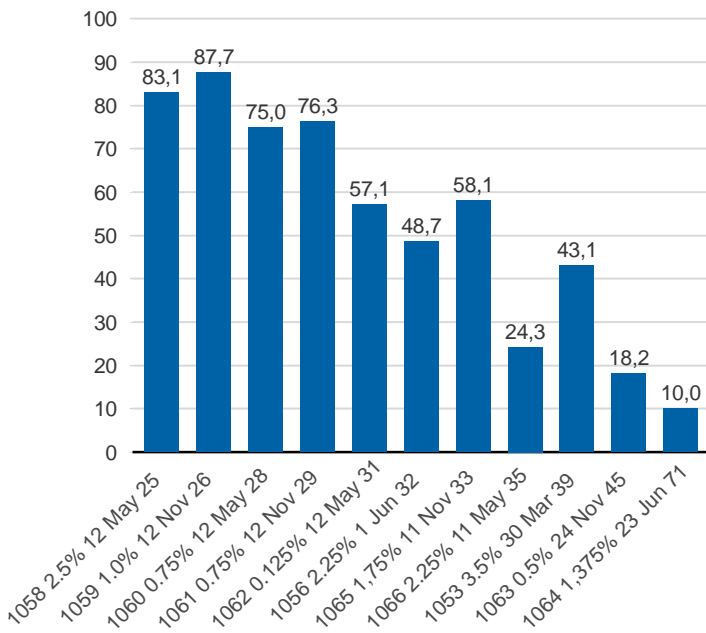
Kapitalmarknadsförfall, uppräknade belopp till aktuella valutakurser, mdkr



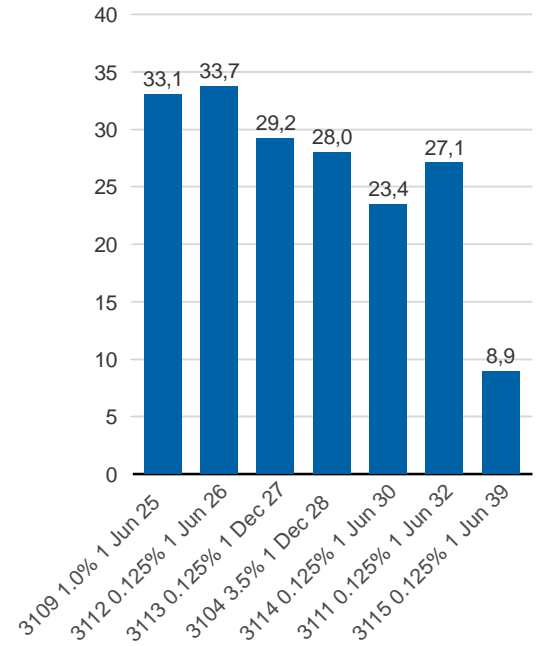
Valutaskuld på kapitalmarknaden inklusive swappar, aktuell valutakurs, mdkr



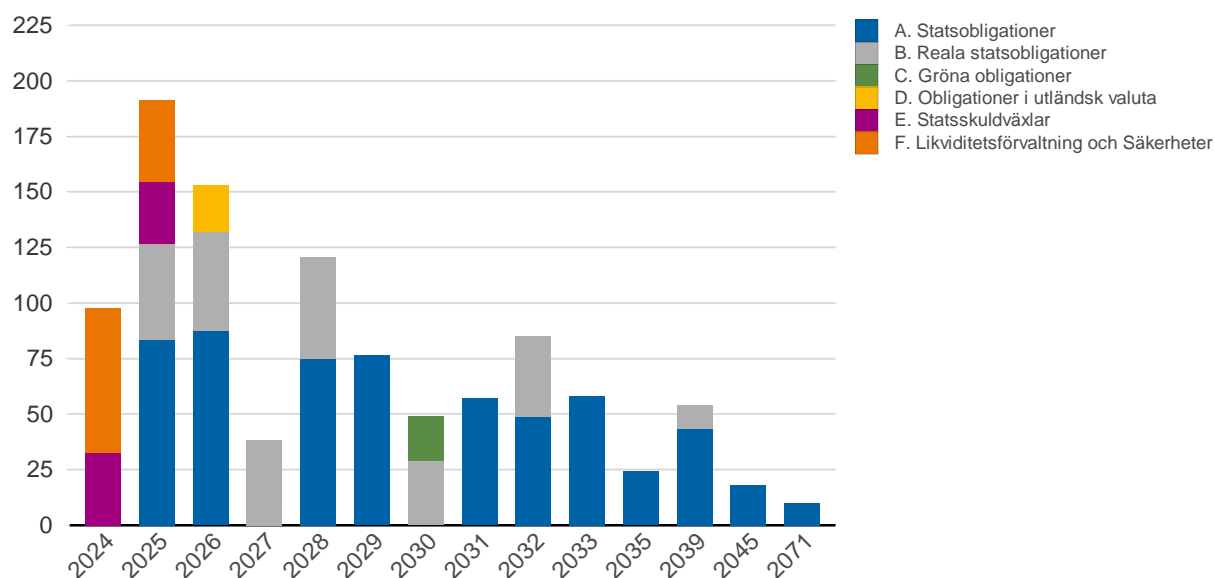
Statsobligationer, nominellt, mdkr



Reala statsobligationer, nominellt, mdkr

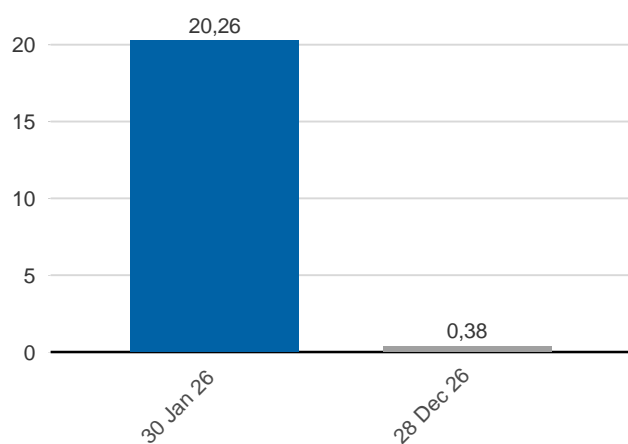


Förfalloprofil för hela skulden, aktuell valutakurs inkl. förvaltningstillgångar, mdkr



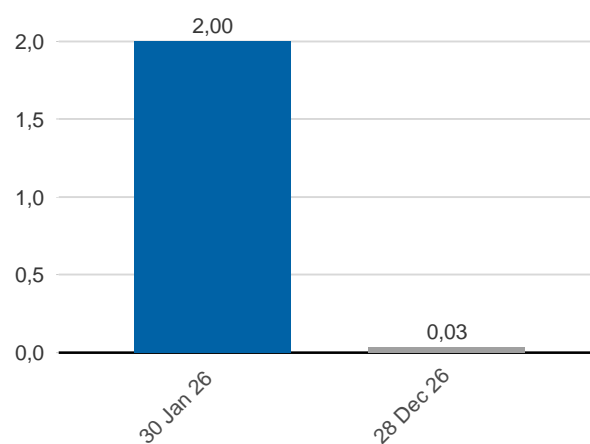
Publ. obligationer i euro och dollar, aktuell valutakurs, mdkr

EUR USD



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

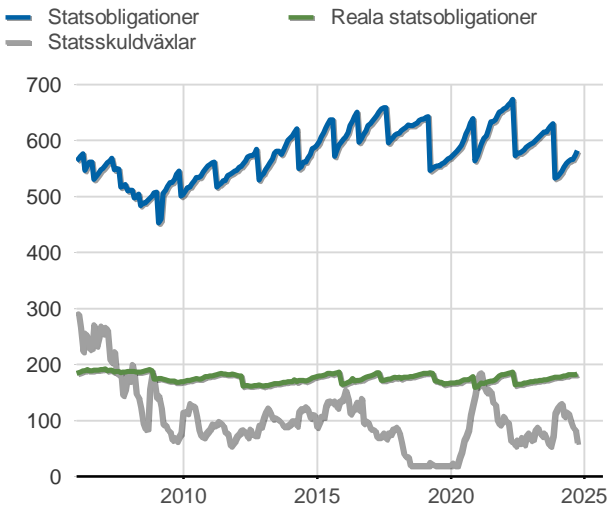
EUR USD



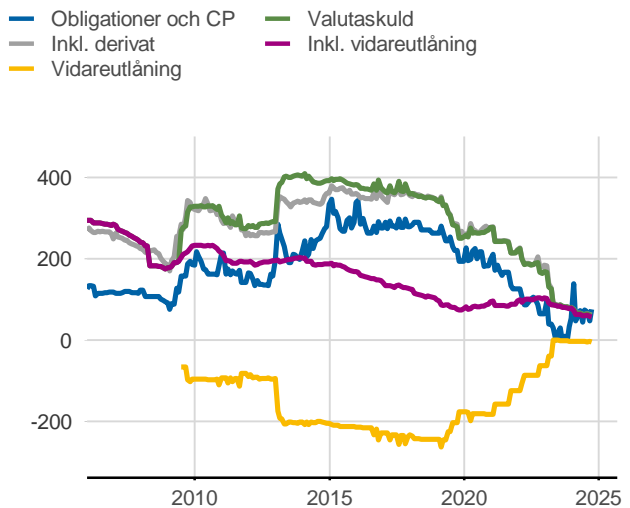
Vidareutlåning

Mottagare	EUR	SDR	USD	Nominellt belopp	Aktuell valutakurs
Vidareutlåning till Riksbanken, IMF	0	298 482 000	0	4 101 414 221	4 101 414 221
	0	298 482 000	0	4 101 414 221	4 101 414 221

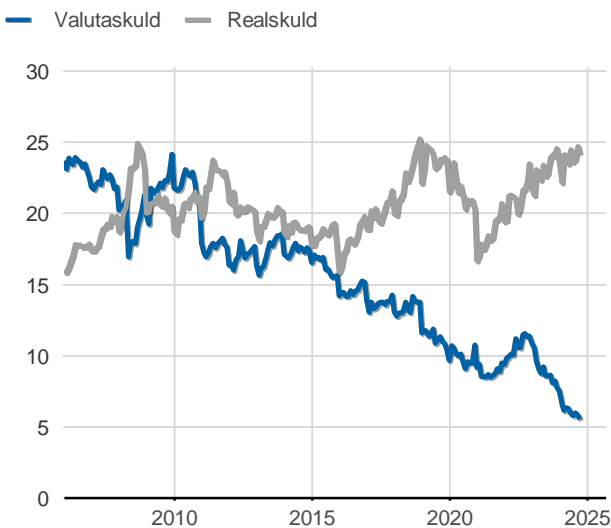
Statsobligationer, rea statsobligationer och statsskuldväxlar, nominella belopp, mdkr



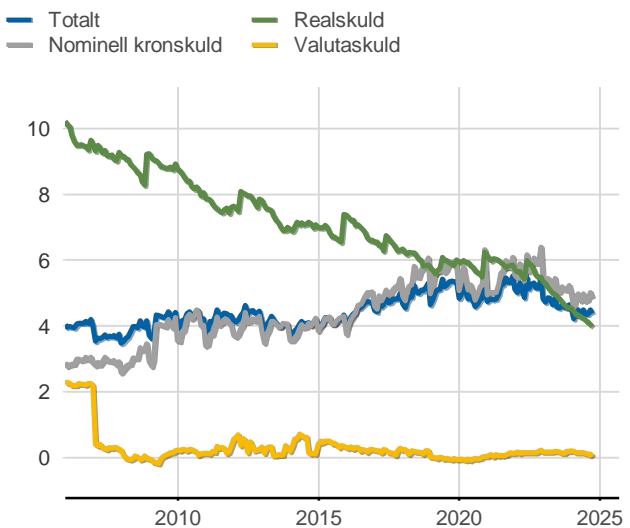
Valutaskuld inkl. vidareutlåning uppdelat på instrument, nominella belopp, mdkr



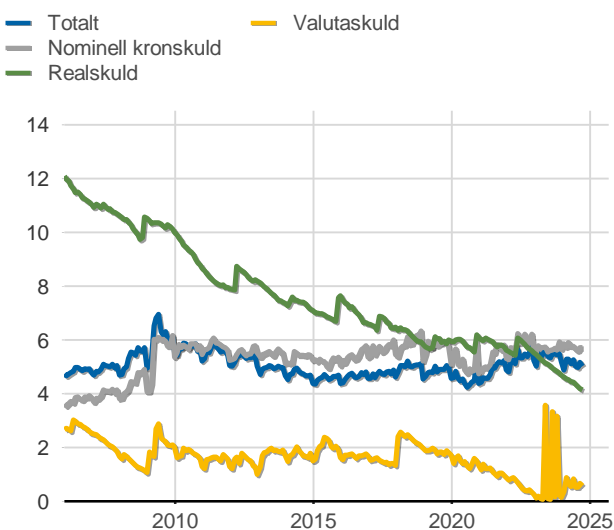
Skuldandelar, inklusive vidareutlåning, procent



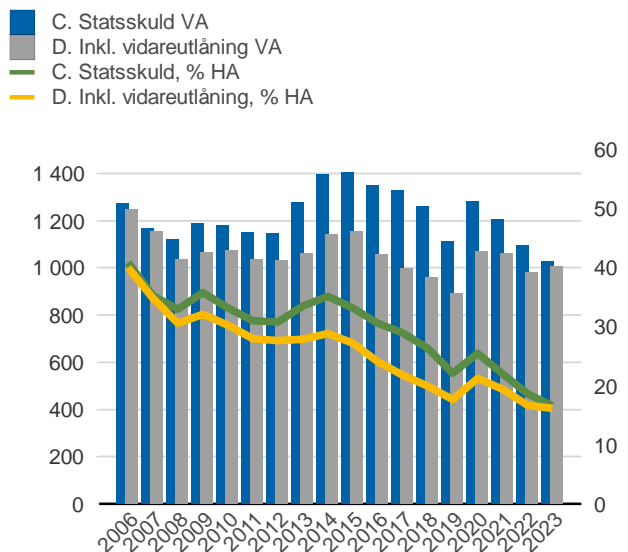
Duration för den totala skulden och respektive skuldslag, inkl. vidareutlåning, år



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	581 650 450 000	60,1	581 650 450 000	60,4	0	
	Reala statsobligationer	183 416 290 000	19,0	183 416 290 000	19,0	0	
	Likviditetsförvaltning	49 074 366 931	5,1	49 074 366 931	5,1	0	
	Statsskuldväxlar	60 000 000 000	6,2	60 000 000 000	6,2	0	
	Gröna obligationer	20 000 000 000	2,1	20 000 000 000	2,1	0	
	Övriga kapitalmarknadsskulder	1 000 000	0,0	1 000 000	0,0	0	
	Säkerheter	-958 832 253	-0,1	-958 832 253	-0,1	0	
		893 183 274 678	92,3	893 183 274 678	92,7	0	
	Utländsk valuta	Likviditetsförvaltning	53 521 241 551	5,5	53 521 241 551	5,6	0
		Obligationer i utländsk valuta	21 197 490 240	2,2	21 197 490 240	2,2	0
Säkerheter		-274 794 544	-0,0	-274 794 544	-0,0	0	
Vidareutlåning		0	0,0	-4 101 414 221	-0,4	4 101 414 221	
		74 443 937 247	7,7	70 342 523 026	7,3	4 101 414 221	
	967 627 211 925	100,0	963 525 797 704	100,0	4 101 414 221		

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 1058 2.5% 12 May 25	1058	SEK	SE0005676608	-	2,5	2014-02-03	2025-05-12	11,3	83 126 000 000	
	SGB 1059 1.0% 12 Nov 26	1059	SEK	SE0007125927	-	1	2015-05-22	2026-11-12	11,5	87 664 000 000	
	SGB 1060 0.75% 12 May 28	1060	SEK	SE0009496367	-	0,75	2017-01-27	2028-05-12	11,3	75 013 000 000	
	SGB 1061 0.75% 12 Nov 29	1061	SEK	SE0011281922	-	0,75	2018-06-01	2029-11-12	11,5	76 339 000 000	
	SGB 1062 0.125% 12 May 31	1062	SEK	SE0013935319	-	0,125	2020-03-27	2031-05-12	11,1	57 140 000 000	
	SGB 1056 2.25% 1 Jun 32	1056	SEK	SE0004517290	-	2,25	2012-03-20	2032-06-01	20,2	48 669 000 000	
	SGB 1065 1,75% 11 Nov 33	1065	SEK	SE0017830730	-	1,75	2022-05-06	2033-11-11	11,5	58 122 000 000	
	SGB 1066 2.25% 11 May 35	1066	SEK	SE0021308541	-	2,25	2024-02-02	2035-05-11	11,3	24 250 000 000	
	SGB 1053 3.5% 30 Mar 39	1053	SEK	SE0002829192	-	3,5	2009-03-30	2039-03-30	30,0	43 105 450 000	
	SGB 1063 0.5% 24 Nov 45	1063	SEK	SE0015193313	-	0,5	2020-11-24	2045-11-24	25,0	18 222 000 000	
	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	33 050 000 000
		SGB IL 3112 0.125% 1 Jun 26	3112	SEK	SE0008014062	-	0,125	2016-02-15	2026-06-01	10,3	33 708 000 000
		SGB IL 3113 0.125% 1 Dec 27	3113	SEK	SE0009548704	-	0,125	2017-02-06	2027-12-01	10,8	29 216 000 000
		SGB IL 3104 3.5% 1 Dec 28	3104	SEK	SE0000556599	-	3,5	1999-04-22	2028-12-01	29,6	27 996 290 000
		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	23 441 000 000
SGB IL 3111 0.125% 1 Jun 32		3111	SEK	SE0007045745	-	0,125	2015-04-30	2032-06-01	17,1	27 088 500 000	
SGB IL 3115 0.125% 1 Jun 39		3115	SEK	SE0016786560	-	0,125	2021-09-06	2039-06-01	17,7	8 916 500 000	
Publika obligationer, utländsk valuta	EUB USD 4.375% 30 Jan 26		USD	XS2756364795	US87020D2C78	4,375	2024-01-30	2026-01-30	2,0	2 000 000 000	
	ESB EUR 9.405% 28 Dec 26		EUR	ES0273315038		9,405	1996-04-09	2026-12-28	30,7	33 205 918	
Statsskuldväxlar	STB 16 Oct 24		SEK	SE0022421475		-	ZC	2024-07-05	2024-10-16	0,3	5 000 000 000
	STB 20 Nov 24		SEK	SE0022574943		-	ZC	2024-08-09	2024-11-20	0,3	12 500 000 000
	STB 18 Dec 24		SEK	SE0021148723		-	ZC	2023-12-01	2024-12-18	1,0	15 000 000 000
	STB 19 Mar 25		SEK	SE0021628484		-	ZC	2024-03-08	2025-03-19	1,0	7 500 000 000
	STB 18 Jun 25		SEK	SE0022243051		-	ZC	2024-06-14	2025-06-18	1,0	12 500 000 000
	STB 17 Sep 25		SEK	SE0022757720		-	ZC	2024-09-06	2025-09-17	1,0	7 500 000 000
	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.

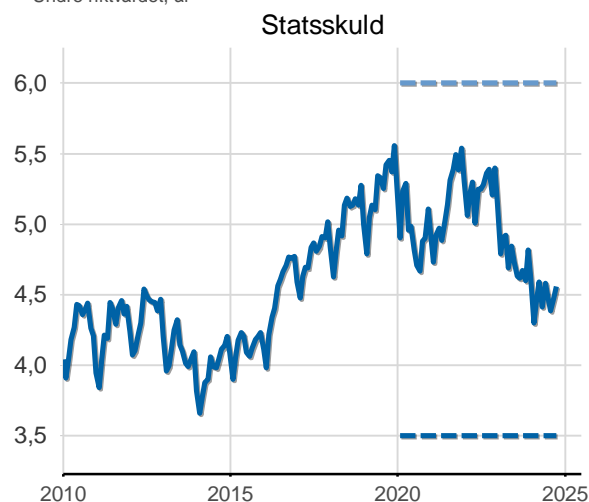
Andelar och löptid (duration) i Riksgäldens riskstyrning

	Skuldmått riskstyrning	Andelar månadsgenomsnitt	Duration månadsgenomsnitt
Nominell kronskuld	672 136 237 140	68,2	5,20
Real kronskuld	247 786 707 164	25,1	4,02
Valutaskuld	65 954 716 207	6,7	0,15
	985 877 660 511	100,0	4,56

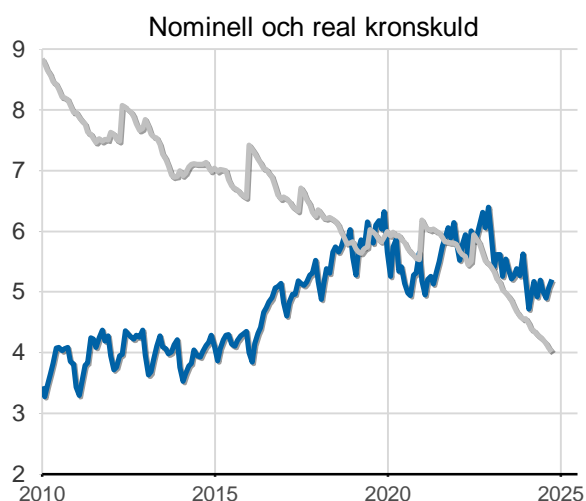
Löptid (duration), år, månadsgenomsnitt

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

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



— Nominell kronskuld, år
— Realskuld, år

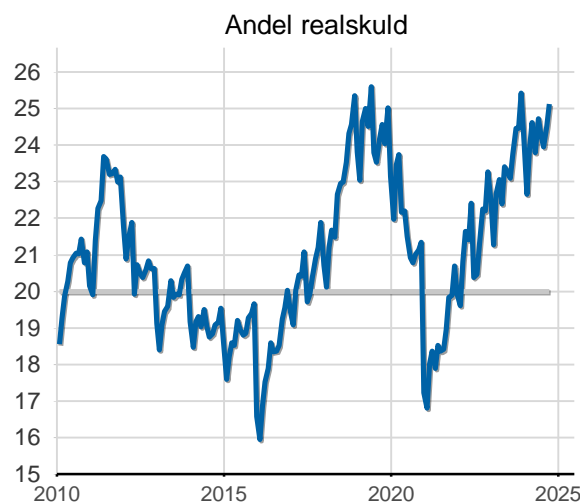


Skuldandelar, %, månadsgenomsnitt

Riktvärdena för skuldandelarna är fr.o.m. 2023: Real kronskuld: 20 %

Valutaexponering: Statsskuldens strategiska exponering i utländsk valuta ska avvecklas successivt och anta riktvärdet noll från och med 2027

— Riktvärde för realskulden, %
— Realskuld, %



— Valutaskuld till aktuell valutakurs, mdkr

