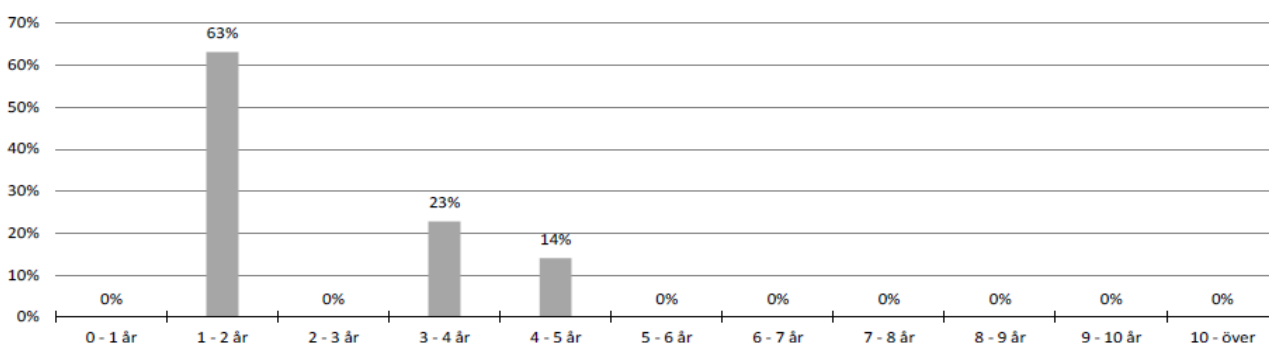


1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning (inkl db)	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	5 851 049	3 487 905	2 363 144
Swapvolym (tkr)	1 425 000	0	1 425 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	17 541	16 372	1 169
Snittränta exkl borgensavg	0,30%	0,47%	0,05%
Genomsnittlig marginal	0,15%	0,49%	-0,35%
Återstående räntebindningstid	1,2	0,9	1,48
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	1,59	1,95	1,07
Andel räntejustering inom 12 mån	62%	66%	56%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	44%	43%	44%

1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	24 Mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 854 Mkr	3 533 Mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	0,4 år	OK
Minst antal ISDA-avtal med derivatmotparter	5	6	OK
Ram extern upplåning (se punkt 2a)			OK
Ram utlåning (se punkt 3a)			OK
Mandat räntebindning (se punkt 4b)			OK
Motpartsrisk derivatkontrakt (per motpart)	Beroende på motpart		OK

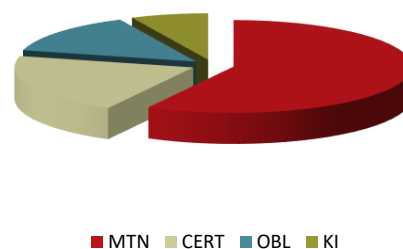
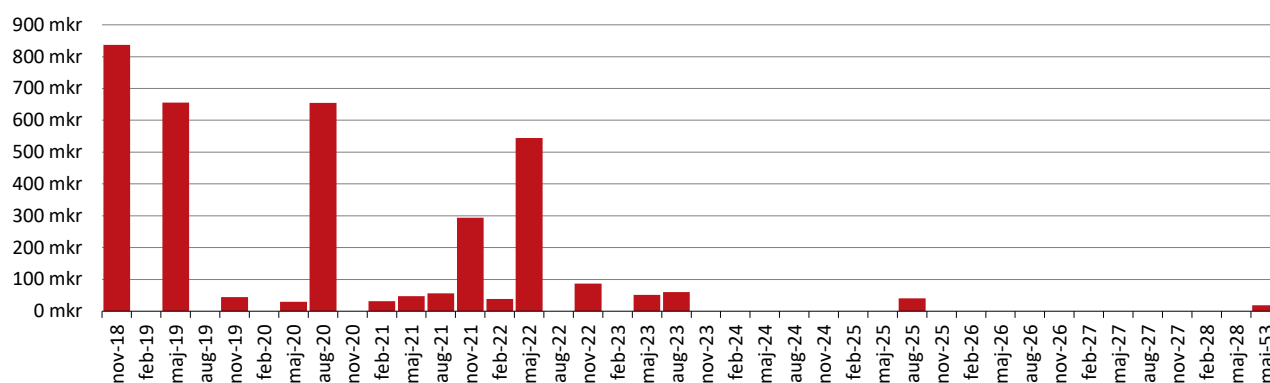
1c. FÖRKLARING TILL EVENTUELL AVVIKELSE**2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR**


	Rambelopp (mkr)	2018-08-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 688	7 344
EVP	893	153
Certprogram	2 000	1 200
MTN-program	8 000	3 300

Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av outnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 300 000	5	58%
CERT	1 200 000	13	21%
OBL	800 000	1	14%
KI	400 000	1	7%
CHECK	0	0	0%
Summa	5 700 000	20	100%


3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

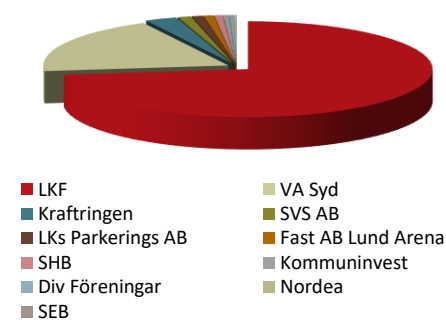
	Rambelopp (mkr)	2018-08-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 350
LK Parkering	200	34
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	673
Sydvatten	322	243
SVS	55	40

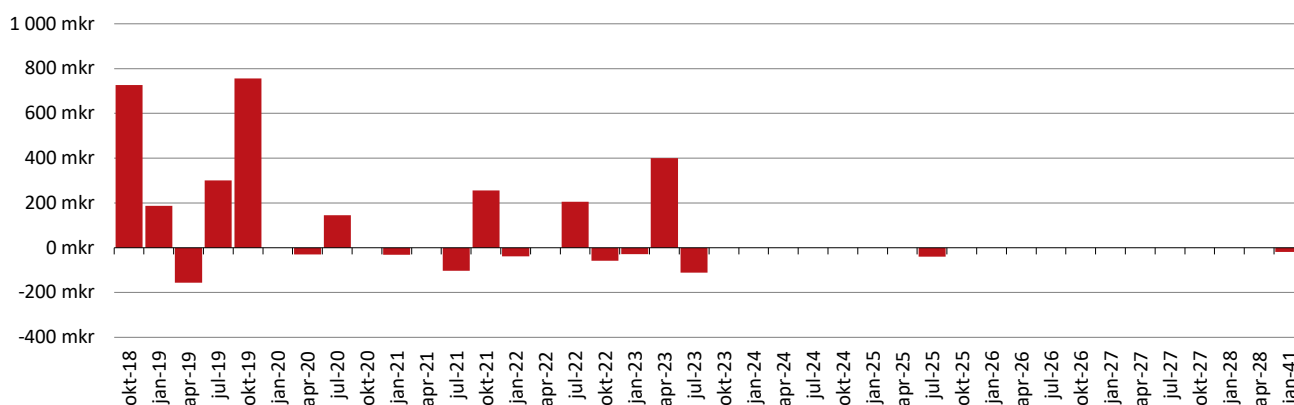
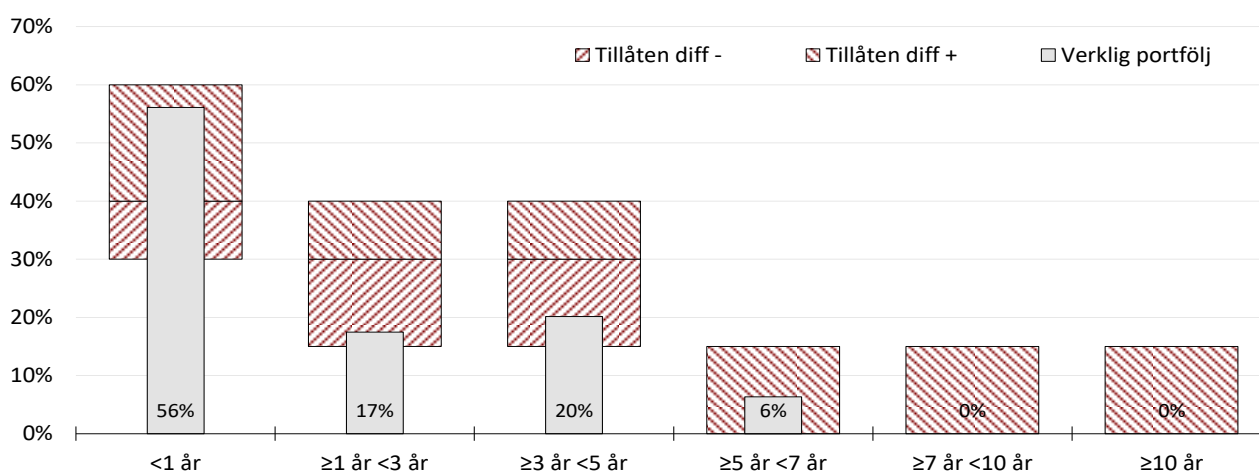
Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2018-08-31
LKF	175	
LK Parkering	100	34
Kraftringen	120	97

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Akt. Volym (tkr)	Antal pos	% av tot volym
LKF	2 550 000	10	73%
VA Syd	672 784	14	19%
Kraftringen	97 119	1	3%
SVS AB	40 000	6	1%
LKs Parkerings AB	33 927	1	1%
Fast AB Lund Arena	30 161	1	1%
SHB	24 422	1	1%
Kommuninvest	18 300	1	1%
Div Föreningar	12 334	1	0%
Nordea	6 908	1	0%
SEB	1 951	1	0%
Summa	3 487 906	38	100%



4a. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDING

4b. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL RÄNTEBINDNING

4c. NETTOPORTFÖLJ - MARKNADSVÄRDE DERIVAT PER MOTPART (mkr)

Motpart	Volym	Värde	Gräns	Antal pos	% av exp	Snittvolym
Swedbank	125	0,8	-200	1	9%	125
SHB	150	1,4	-200	1	11%	150
Nordea	400	27,3	-200	2	28%	200
Danske	750	4,2	-200	6	53%	125
Summa	1 425	33,6		10	100%	143

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Bas		22,5	24,2	35,5	55,1	71,0
Hög		22,7	29,3	55,4	99,0	137,1
Låg		22,2	19,4	19,1	18,0	13,1
varav löftesprovision		1,1	1,1	1,1	1,1	1,1
Utgående nettoskuldvolym	1 987	2 519	3 406	4 510	5 589	5 589

5. PLACERINGAR

<u>Tillgångsslag</u>	<i>Bokfört värde</i>	<i>Marknadsvärde 2017-12-31</i>	<i>Marknadsvärde 2018-08-31</i>	<i>%-förändring från årskiftet</i>	<i>Fördeln %</i>	<i>Placeringslimiter</i>	
						<i>Lägst %</i>	<i>Högst %</i>
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun	215 696 902	386 701 902	387 949 660	0,3%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-88 284 401	-157 487 219	-157 995 378	0,3%			
<u>Summa räntebärande placeringar</u>	127 412 501	229 214 683	229 954 282	0,3%	52	40	60
				0			
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Ethica Sverige	22 690 342	26 958 222	28 924 587	7,3%			
Öhman Sverige Hållbar A	30 885 333	34 992 769	37 868 983	8,2%			
SPP Sverige Plus	10 005 090	11 447 393	12 743 357	11,3%			
Delsumma svenska fonder	63 580 764	73 398 384	79 536 928	8,4%	18		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Ethica global	24 064 448	24 432 735	29 321 603	20,0%			
SHB Global 90	22 000 000	24 779 770	26 329 198	6,3%			
SPP Global Plus	10 014 635	13 078 396	15 044 111	15,0%			
Öhman Global Hållbar A	10 108 952	11 933 697	14 078 904	18,0%			
Delsumma globala fonder	66 188 036	74 224 598	84 773 816	14,2%	19		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Vatten	3 300 000	3 564 300,00	3 531 900	-0,9%			
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 954 700,00	2 934 000	-0,7%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 168 000,00	3 962 000	-4,9%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 977 720,00	2 977 380	0,0%			
Delsumma strukturerade prod	14 280 000	13 664 720	13 405 280	-1,9%	3	0	25
<u>Summa aktierelaterade placeringar</u>	144 048 800	161 287 702	177 716 024	10,2%	41	30	50
Likvida medel							
Depåkonto Handelsbanken		30 994 613	31 099 587				
Delsumma		30 994 613	31 099 587		7	0	10
Summa Pensionsmedel		421 496 998	438 769 893	4,1%	100		

I marknadsvärde per 2018-08-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.