

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	5 824 550	3 557 183	2 267 367
Swapvolym (tkr)	1 425 000	0	1 425 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	17 462	16 719	743
Snittränta exkl borgensavg	0,30%	0,47%	0,03%
Genomsnittlig marginal	0,15%	0,47%	-0,36%
Återstående räntebindningstid	1,2	0,9	1,60
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	1,54	1,89	1,00
Andel räntejustering inom 12 mån	62%	67%	54%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	44%	43%	45%

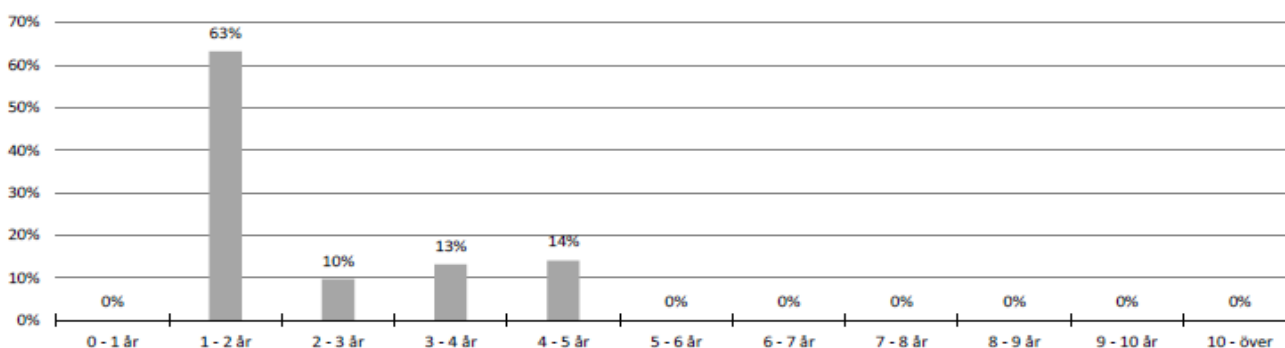
1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	153 Mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 870 Mkr	3 663 Mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	0,3 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

Liten avvikelse om 0,52 %-enheter i intervall 3-5 år i graf 4 b. Motsvarar ca 12 Mkr och rättas till utan att vidta några åtgärder till rapporteringen per 2018-10-31.

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR

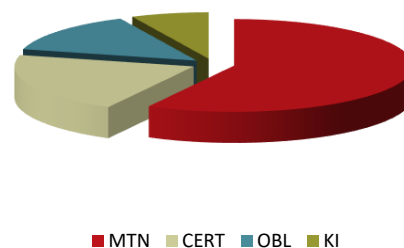
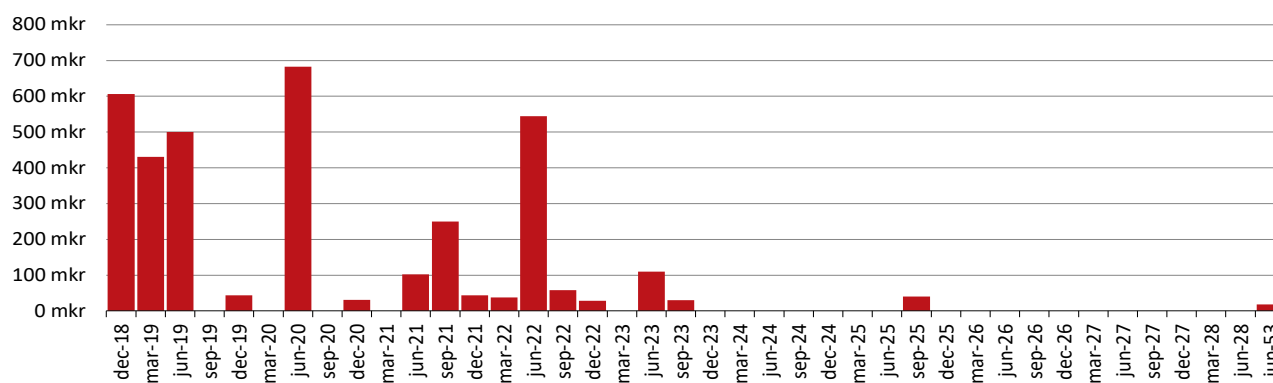


	Rambelopp (mkr)	2018-09-30
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 688	7 344
EVP	893	57
Certprogram	2 000	1 200
MTN-program	8 000	3 300

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

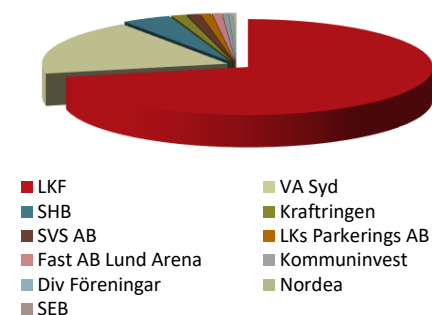
	Rambelopp (mkr)	2018-09-30
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	1 800
LK Parkering	400	34
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	666
Sydvatten	322	243
SVS	55	40

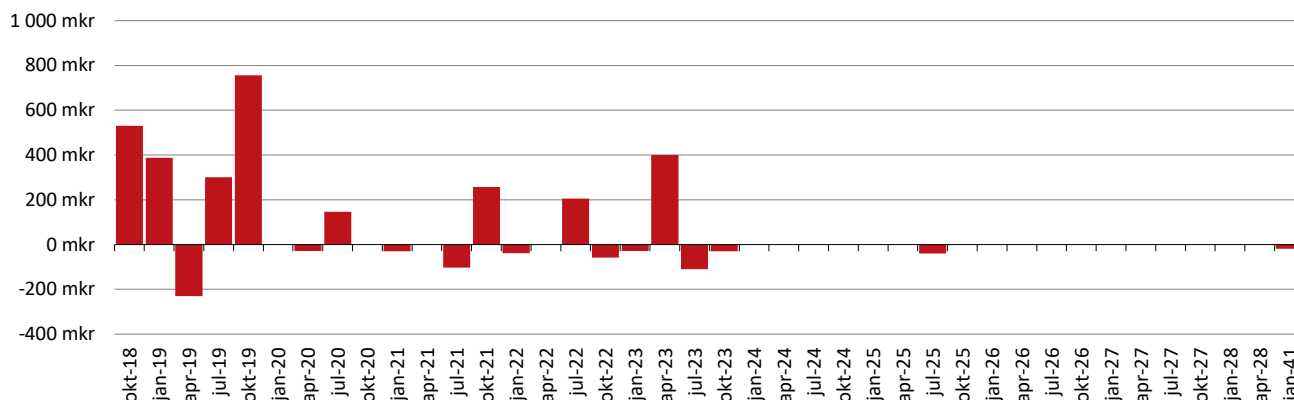
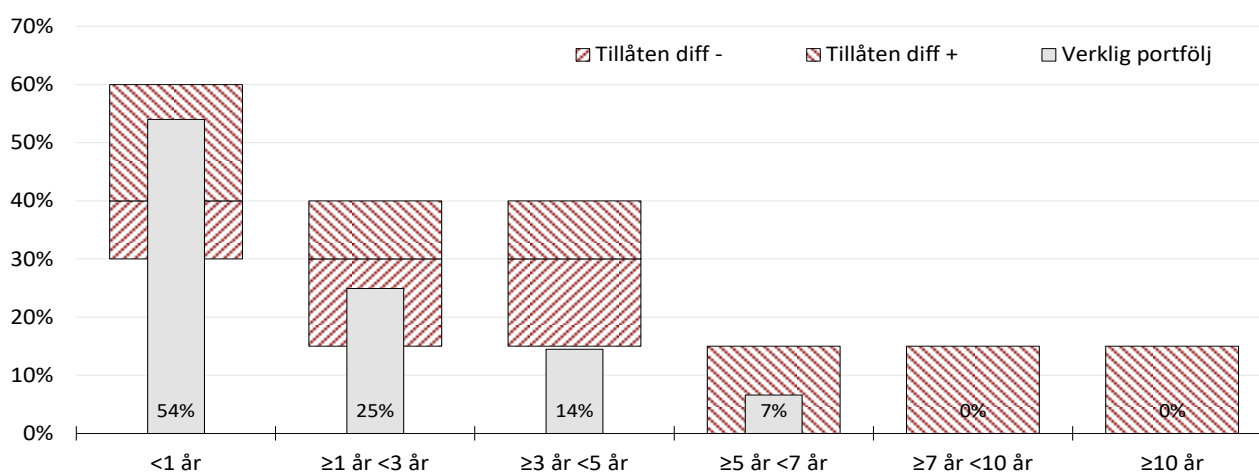
Koncernkontolimiter

	Rambelopp (mkr)	2018-09-30
LKF	175	
LK Parkering	100	34
Kraftringen	120	44

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Akt. Volym (tkr)	Antal pos	% av tot volym
LKF	2 550 000	8	72%
VA Syd	666 269	14	19%
SHB	152 813	1	4%
Kraftringen	43 844	1	1%
SVS AB	40 000	6	1%
LKs Parkerings AB	34 114	1	1%
Fast AB Lund Arena	30 000	1	1%
Kommuninvest	18 300	1	1%
Div Föreningar	12 334	1	0%
Nordea	7 558	1	0%
SEB	1 951	1	0%
Summa	3 557 183	36	100%



4a. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING

4b. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL RÄNTEBINDNING

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

Motpart	Volym	Värde	Gräns	Antal pos	% av exp	Snittvolym
Swedbank	125	0,6	-200	1	9%	125
SHB	150	0,2	-200	1	11%	150
Nordea	400	25,1	-200	2	28%	200
Danske	750	1,3	-200	6	53%	125
Summa	1 425	27,1		10	100%	143

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Bas		17,9	23,9	36,0	58,3	77,2
Hög		17,9	28,0	53,2	98,1	139,9
Låg		17,9	20,1	21,7	24,7	22,4
varav löftesprovision		1,1	1,1	1,1	1,1	1,1
varav borgensavgift (intäkt)						
Utgående nettoskuldvolym	1 987	2 519	3 406	4 510	5 589	5 589

5. PLACERINGAR

Tillgångsslag	Bokfört värde	Marknadsvärde		%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
		2017-12-31	2018-09-30			Lägst %	Högst %
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%			
Summa räntebärande placeringar	127 412 501	229 214 683	229 954 282	0,3%	53	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Ethica Sverige	22 690 342	26 958 222	28 944 140	7,4%			
Öhman Sverige Hållbar A	30 885 333	34 992 769	37 967 179	8,5%			
SPP Sverige Plus	10 005 090	11 447 393	12 736 753	11,3%			
Delsumma svenska fonder	63 580 764	73 398 384	79 648 071	8,5%	18		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Ethica global	24 064 448	24 432 735	29 007 412	18,7%			
SHB Global 90	22 000 000	24 779 770	25 797 966	4,1%			
SPP Global Plus	10 014 635	13 078 396	14 737 054	12,7%			
Öhman Global Hållbar A	10 108 952	11 933 697	13 820 019	15,8%			
Delsumma globala fonder	66 188 036	74 224 598	83 362 450	12,3%	19		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Vatten	3 300 000	3 564 300,00	3 518 700	-1,3%			
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 954 700,00	2 872 500	-2,8%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 168 000,00	3 944 800	-5,4%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 977 720,00	3 002 880	0,8%			
Delsumma strukturerade prod	14 280 000	13 664 720	13 338 880	-2,4%	3	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	144 048 800	161 287 702	176 349 401	9,3%	40	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	437 403 271	3,8%	100		

I marknadsvärde per 2018-09-30 för återlånet och för avräkningsskuden ingår kapital jämte upplupen ränta.