

## 1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 368 950	3 646 110	2 722 840
Swapvolym (tkr)	1 725 000	0	1 725 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	28 023	20 600	7 423
Snittränta exkl borgensavg	0,44%	0,56%	0,27%
Genomsnittlig marginal	0,15%	0,41%	-0,20%
Återstående räntebindningstid	1,22	0,80	1,78
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,55	2,26	2,94
Andel räntejustering inom 12 mån	59%	66%	50%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	25%	26%	24%

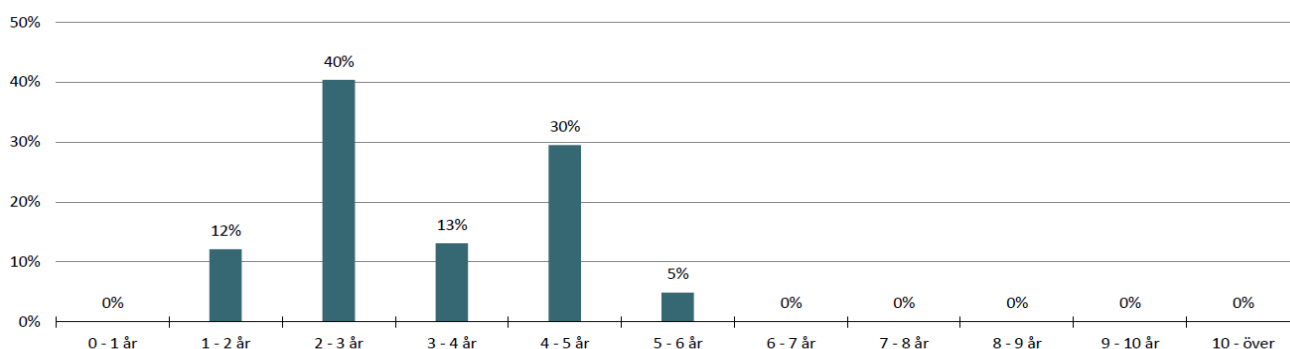
## 1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	461 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	1 849 mkr	3 988 mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	< 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)			EJ OK
Motpartsrisk derivatkontrakt (per motpart)	Beroende på motpart		OK

## 1c. FÖRKLARING TILL EVENTUELL AVVIKELSE

Räntebindningen avviker från normportföljen och de tillhörande riskmandaten för segmentet 3-5 år. 150 mkr kommer att förflyttas från segmentet 5-7 år till 3-5 år under juni månad, vilket gör att normportföljen upprätthålls vid nästa rapporttillfälle. Därför krävs ingen åtgärd.

## 2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING &amp; UPPLÅNINGSRAMAR



	Rambelopp (mkr)	2019-05-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 799	9 012
EVP	581	306
Certprogram	2 000	700
MTN-program	8 000	4 300

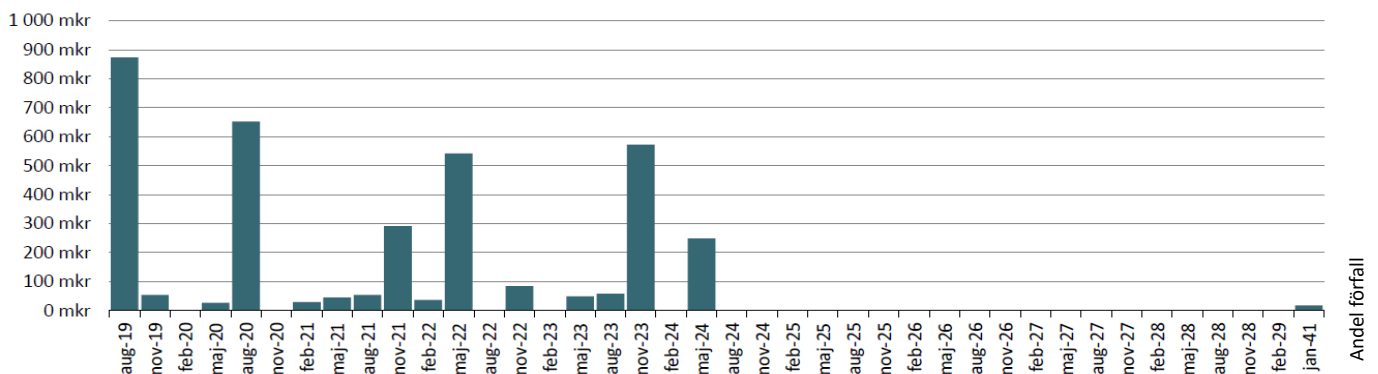
Diagramet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av utnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

**2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER**

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	4 300 000	7	70%
KI	1 100 000	3	18%
CERT	700 000	7	11%
Check	0	1	0%
<b>Summa</b>	<b>6 100 000</b>	<b>18</b>	<b>100%</b>



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

**3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM**

**Utlånings- och borgensramar**

	Rambelopp (mkr)	2019-05-31
<b>Majoritetsägda bolag</b>		
LKF	7 000	4 700
LK Parkerings	400	96
Kraftringen	-	-
<b>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</b>		
VA Syd	1 000	712
Sydvatten	322	243
SVS	55	0

**Koncernkontolimit**

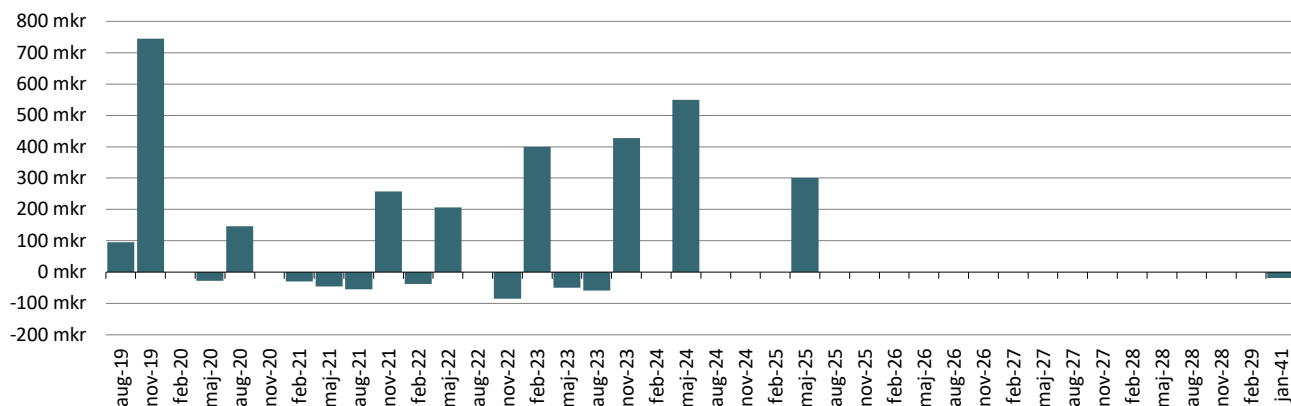
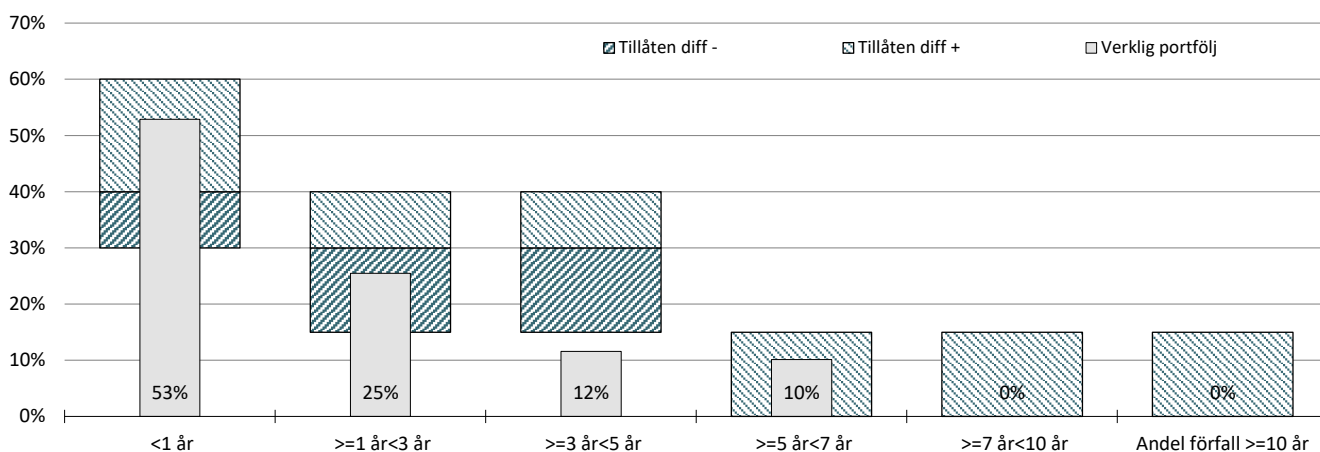
	Rambelopp (mkr)	2019-05-31
LKF	175	
LKs Parkerings AB	100	96
Kraftringen	120	0

**3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE**

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 300 000		2 300 000	63%
VA Syd	712 330		712 330	20%
Nordea		460 990	460 990	13%
LKs Parkerings AB	95 804		95 804	3%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	1%
SHB		12 102	12 102	0%
Div föreningar	11 812		11 812	0%
Övriga Banker		4 772	4 772	0%
<b>Summa</b>	<b>3 168 246</b>	<b>477 864</b>	<b>3 646 110</b>	<b>100%</b>



■ LKF ■ VA Syd  
 ■ Nordea ■ LKs Parkerings AB  
 ■ Fast. AB Lund Arena ■ Kommuninvest  
 ■ SHB ■ Div föreningar  
 ■ Övriga Banker

**4a. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING**

**4b. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL RÄNTEBINDNING**

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

Motpart	Volym	Värde	Gräns	Antal pos	% av exp	Snittvolym
SHB	275	4,0	-200	2	16%	138
SEB	150	1,3	-200	1	9%	150
Nordea	400	22,9	-200	2	23%	200
Danske	900	9,6	-200	7	52%	129
<b>Summa</b>	<b>1 725</b>	<b>37,9</b>		<b>12</b>	<b>100%</b>	<b>144</b>

**4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS**

	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Bas		25,9	21,3	25,6	27,4	29,9
Hög		26,4	26,2	38,6	50,8	63,1
Låg		25,3	16,7	14,4	7,7	1,6
<b>Utgående nettoskuldvolym</b>	<b>2 417</b>	<b>2 998</b>	<b>3 488</b>	<b>3 922</b>	<b>3 922</b>	<b>3 922</b>

## 5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

Tillgångsslag	Bokfört värde	Marknadsvärde 2018-12-31	Marknadsvärde 2019-05-31	%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
						Lägst %	Högst %
<b>Räntebärande placeringar</b>							
Återlån till Lunds kommun	440 649 902	440 649 902	441 167 421	0,1%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-169 242 708	-169 242 708	-169 441 474	0,1%			
<b>Summa räntebärande placeringar</b>	<b>271 407 194</b>	<b>271 407 194</b>	<b>271 725 947</b>	<b>0,1%</b>	<b>57</b>	<b>40</b>	<b>60</b>
<b>Aktierelaterade placeringar</b>							
<b>Svenska aktiefonder</b>							
Robur Ethica Sverige	22 912 671	24 901 590	27 879 457,12	12,0%			
Öhman Sverige Hållbar A	31 144 650	32 084 994	35 847 097,40	11,7%			
SPP Sverige Plus	10 010 987	11 067 366	12 416 957,76	12,2%			
<b>Delsumma svenska fonder</b>	<b>64 068 308</b>	<b>68 053 951</b>	<b>76 143 512,28</b>	<b>11,9%</b>	<b>16</b>		
<b>Globala aktiefonder</b>							
Robur Ethica global	24 274 825	25 537 819	30 126 252,65	18,0%			
SHB Global 90	22 000 000	23 469 070	26 292 243,83	12,0%			
SPP Global Plus	10 028 193	12 838 091	15 089 432,33	17,5%			
Öhman Global Hållbar A	10 182 981	12 111 161	14 047 725,90	16,0%			
<b>Delsumma globala fonder</b>	<b>66 485 998</b>	<b>73 956 141</b>	<b>85 555 654,71</b>	<b>15,7%</b>	<b>18</b>		
<b>Strukturerade produkter</b>							
Garantum Vatten	3 300 000	3 129 600,00	3 592 200	14,8%			
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 684 400,00	3 039 900	13,2%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	3 836 000,00	4 086 400	6,5%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 975 680,00	2 990 300	0,5%			
<b>Delsumma strukturerade prod</b>	<b>14 280 000</b>	<b>12 625 680</b>	<b>13 708 800</b>	<b>8,6%</b>	<b>3</b>	<b>0</b>	<b>25</b>
<b>Summa aktierelaterade placeringar</b>	<b>144 834 307</b>	<b>154 635 772</b>	<b>175 407 967</b>	<b>13,4%</b>	<b>37</b>	<b>30</b>	<b>50</b>
<b>Likvida medel</b>							
Depåkonto Handelsbanken		31 099 587	31 099 587				
<b>Delsumma</b>		<b>31 099 587</b>	<b>31 099 587</b>		<b>7</b>	<b>0</b>	<b>10</b>
<b>Summa Pensionsmedel</b>		<b>457 142 553</b>	<b>478 233 501</b>	<b>4,6%</b>	<b>100</b>		

I marknadsvärde per 2019-05-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.