

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

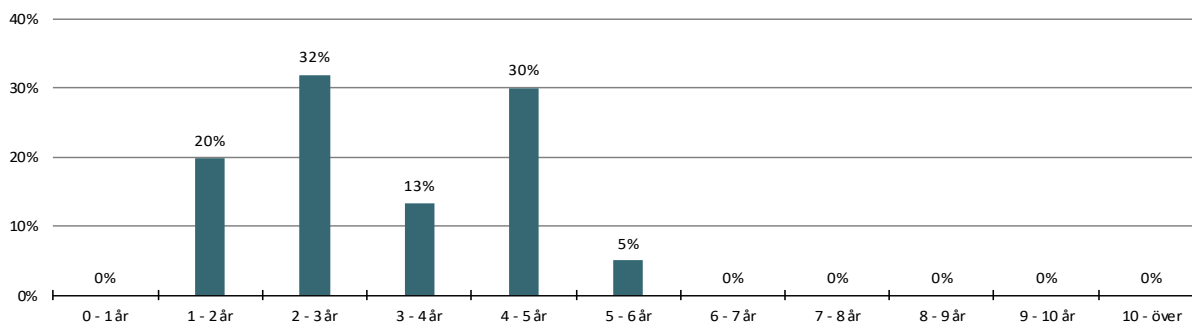
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 127 675	3 390 427	2 737 249
Swapvolym (tkr)	1 975 000	0	1 975 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	26 962	20 596	6 366
Snittränta exkl borgensavg	0,44%	0,61%	0,23%
Genomsnittlig marginal	0,15%	0,44%	-0,21%
Återstående räntebindningstid	1,31	0,79	1,95
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,37	2,23	2,55
Andel räntejustering inom 12 mån	68%	81%	51%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	38%	38%	37%

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	264 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 776 mkr	3 986 mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	-0,1 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)	2019-09-30
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 799	8 780
EVP	581	320
Certprogram	2 000	600
MTN-program	8 000	4 300

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.

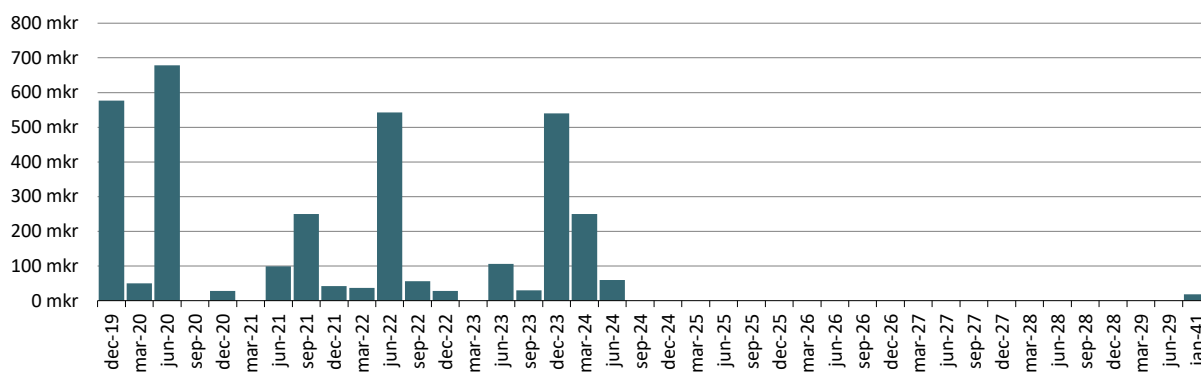
2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	4 300 000	7	72%
KI	1 100 000	3	18%
CERT	600 000	7	10%
Check	0	1	0%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

Summa	6 000 000	18	100%
--------------	------------------	-----------	-------------

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2019-09-30
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 650
LK Parkerings	400	123
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	758
Sydvatten	322	252
SVS	55	0

Koncernkontroller

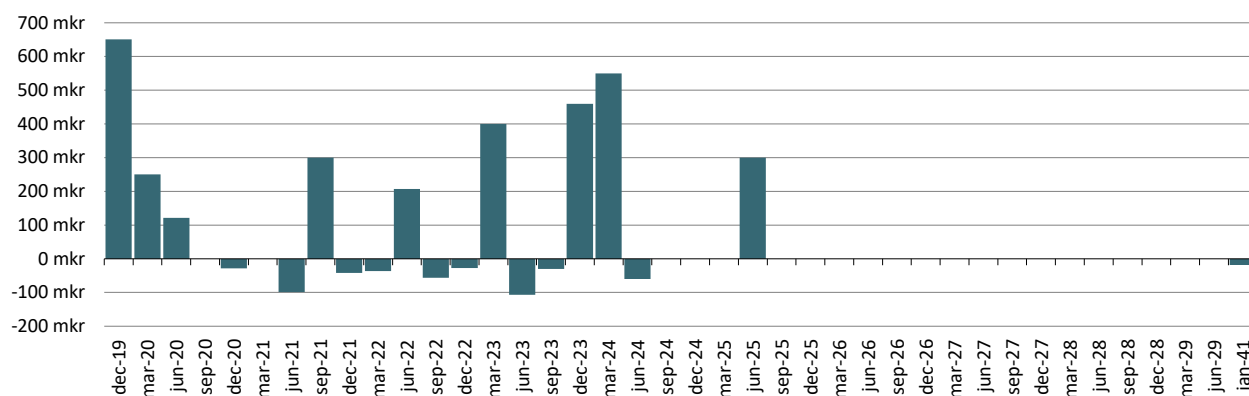
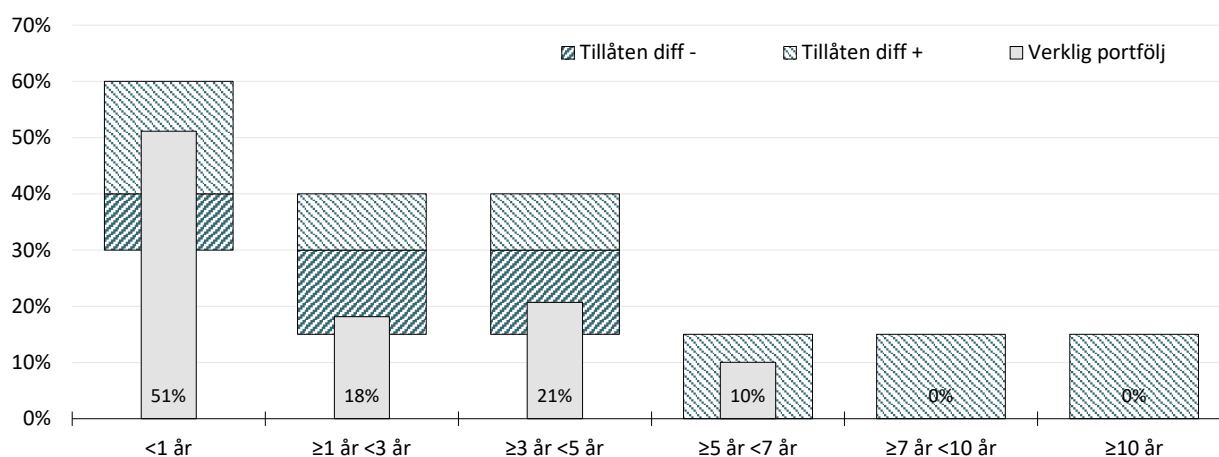
	Rambelopp (mkr)	2019-09-30
LKF	275	
LK Parkerings AB	100	23
Kraftringen	120	30

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 250 000		2 250 000	66%
VA Syd	757 936		757 936	22%
Nordea		264 233	264 233	8%
Kraftringen	30 277		30 277	1%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
LK Parkerings AB	23 045		23 045	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	1%
Div föreningar	11 615		11 615	0%
Övriga banker		3 008	3 008	0%
SHB		2 012	2 012	0%
Summa	3 121 173	269 253	3 390 426	100%



■ LKF ■ VA Syd
 ■ Nordea ■ Kraftringen
 ■ Fast. AB Lund Arena ■ LK Parkerings AB
 ■ Kommuninvest ■ 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	425	7,9	-200	3	22%	142
SEB	150	3,4	-200	1	8%	150
Nordea	400	21,9	-200	2	20%	200
Danske	1000	14,9	-200	8	51%	125
Summa	1 975	48,0		14	100%	141

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Bas		22,4	18,8	18,7	16,4	14,8
Hög		22,4	22,9	28,5	34,8	43,2
Låg		22,4	14,7	8,7	-0,9	-10,9
Utgående nettoskuldvolym	2 417	2 969	3 393	3 735	3 967	3 967

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

Tillgångslag	Bokfört värde	Marknadsvärde		%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
		2018-12-31	2019-09-30			Lägst %	Högst %
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun	440 649 902	440 649 902	440 917 230	0,1%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-169 242 708	-169 242 708	-169 345 382	0,1%			
Summa räntebärande placeringar	271 407 194	271 407 194	271 571 848	0,1%	55	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Ethica Sverige	22 912 671	24 901 590	30 249 902	21,5%			
Öhman Sverige Hållbar A	31 144 650	32 084 994	38 317 048	19,4%			
SPP Sverige Plus	10 010 987	11 067 366	13 536 304	22,3%			
Delsumma svenska fonder	64 068 308	68 053 951	82 103 254	20,6%	17		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Ethica global	24 274 825	25 537 819	32 989 575	29,2%			
SHB Global 90	22 000 000	23 469 070	28 478 248	21,3%			
SPP Global Plus	10 028 193	12 838 091	16 810 699	30,9%			
Öhman Global Hållbar A	10 182 981	12 111 161	15 516 173	28,1%			
Delsumma globala fonder	66 485 998	73 956 141	93 794 694	26,8%	19		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Vatten	3 300 000	0,00	0				
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 684 400,00	3 214 800	19,8%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	3 836 000,00	4 243 600	10,6%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 975 680,00	3 021 240	1,5%			
Delsumma strukturerade prod	14 280 000	9 496 080	10 479 640	10,4%	2	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	144 834 307	151 506 172	186 377 588	23,0%	38	30	50
Likvida medel							
Depåkonto Garantum		3 129 600	3 954 600				
Depåkonto Handelsbanken		31 099 587	31 099 587				
Delsumma		34 229 187	35 054 187	2,4%	7	0	10
Summa Pensionsmedel		457 142 553	493 003 623	7,8%	100		

I marknadsvärde per 2019-09-30 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränt