

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

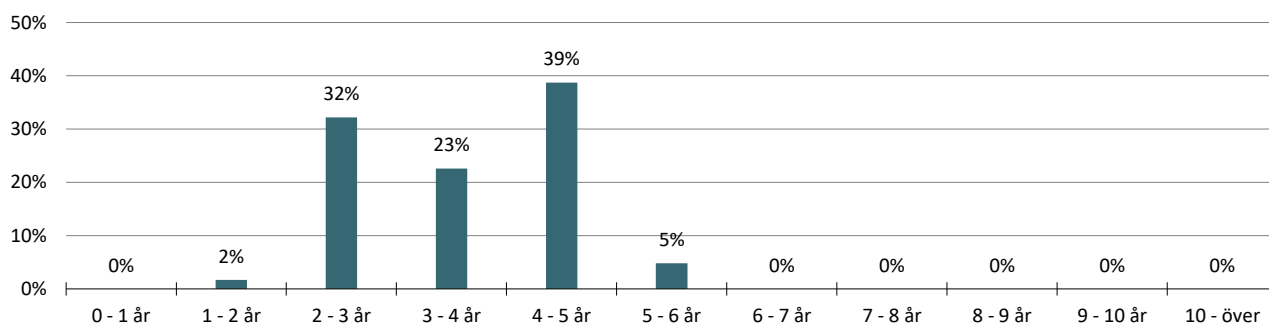
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 446 873	3 709 455	2 737 417
Swapvolym (tkr)	1 975 000	0	1 975 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	24 369	20 410	3 960
Snittränta exkl borgensavg	0,38%	0,55%	0,14%
Genomsnittlig marginal	0,12%	0,41%	-0,27%
Återstående räntebindningstid	1,23	0,76	1,87
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,58	2,05	3,30
Andel räntejustering inom 12 mån	69%	82%	53%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	33%	42%	21%

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	344 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 194	3 772 mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	-0,5 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)	2019-10-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 799	9 099
EVP	581	320
Certprogram	2 000	1 100
MTN-program	8 000	3 500

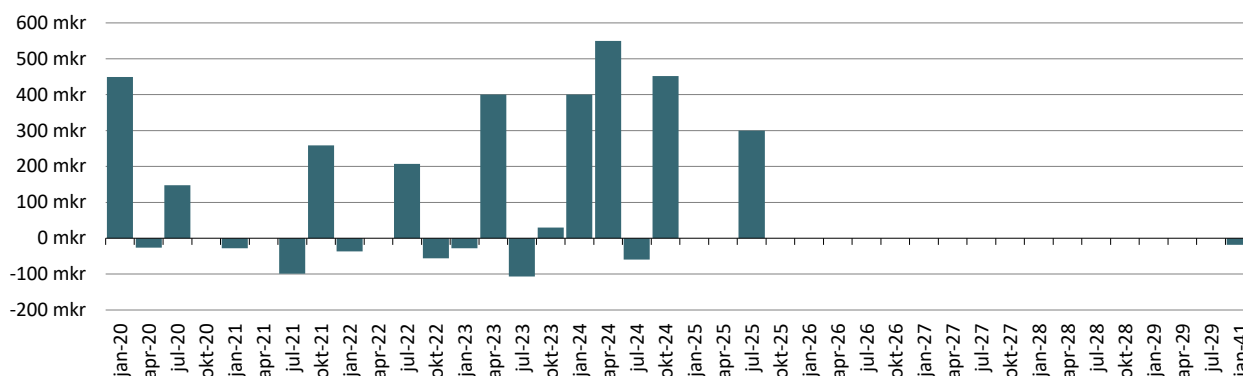
Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskas därmed av utnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 500 000	6	56%
KI	1 600 000	4	26%
CERT	1 100 000	9	18%
Check	0	1	0%
Summa	6 200 000	20	100%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2019-10-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 650
LK Parkerings AB	400	130
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	758
Sydvatten	322	252
SVS	55	0

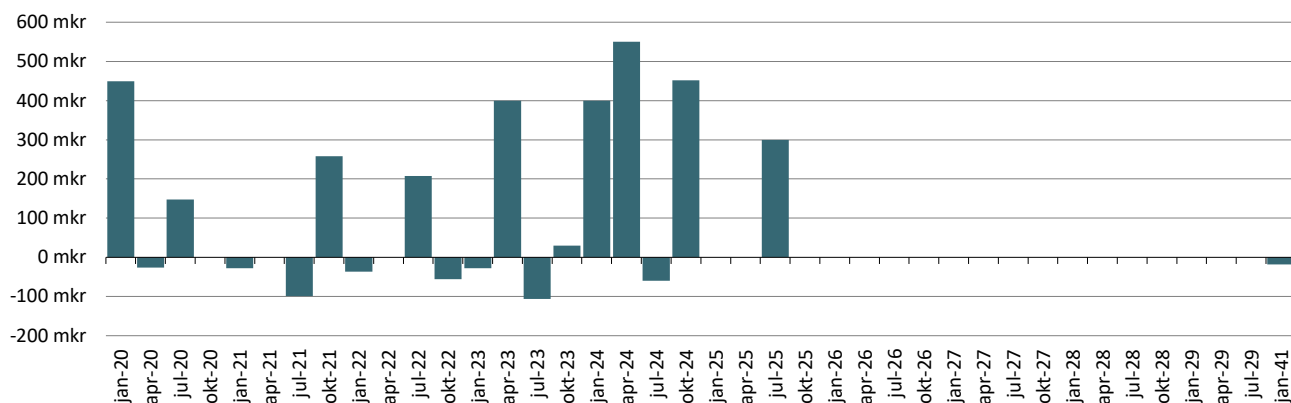
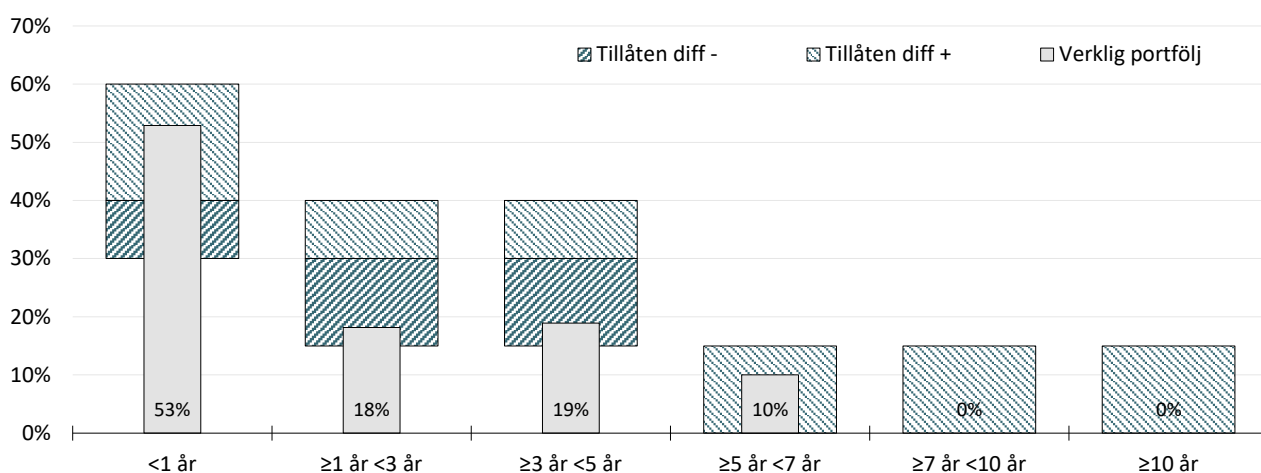
Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2019-10-31
LKF	275	
LK Parkerings AB	100	30
Kraftringen	120	56

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 450 000		2 450 000	66%
VA Syd	757 936		757 936	20%
Nordea		344 036	344 036	9%
Kraftringen	56 293		56 293	2%
LK Parkerings AB	30 254		30 254	1%
fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	0%
Div föreningar	11 615		11 615	0%
AF Borgen	6 000		6 000	0%
Övriga banker		5 021	5 021	0%
Summa	3 360 398	349 057	3 709 455	100%


 ■ LKF ■ VA Syd
 ■ Nordea ■ Kraftringen
 ■ LK Parkerings AB ■ fast. AB Lund Arena
 ■ Kommuninvest ■ Div föreningar
 ■ AF Borgen

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	2,6	-200	3	22%	142
SEB	150	1,7	-200	1	8%	150
Nordea	400	19,1	-200	2	20%	200
Danske	1000	7,3	-200	8	51%	125
Summa	1 975	30,7		14	100%	141

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Bas		22,2	19,7	21,2	20,9	19,5
Hög		22,2	22,6	30,4	38,7	46,9
Låg		22,2	16,9	12,8	4,9	-4,9
Utgående nettoskuldvolym	2 417	2 913	3 337	3 679	3 911	3 911

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

Tillgångsslag	Bokfört värde	Marknadsvärde		%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
		2018-12-31	2019-10-31			Lägst %	Högst %
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun	440 649 902	440 649 902	440 835 954	0,0%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-169 242 708	-169 242 708	-169 314 166	0,0%			
Summa räntebärande placeringar	271 407 194	271 407 194	271 521 788	0,0%	55	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sverige	22 912 671	24 901 590	31 825 960	27,8%			
Öhman Sverige Hållbar A	31 144 650	32 084 994	39 658 227	23,6%			
SPP Sverige Plus A	10 010 987	11 067 366	14 058 304	27,0%			
Delsumma svenska fonder	64 068 308	68 053 951	85 542 490	25,7%	17		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 274 825	25 537 819	33 496 931	31,2%			
SHB Global Dynamisk 90	22 000 000	23 469 070	29 146 136	24,2%			
SPP Global Plus A	10 028 193	12 838 091	17 047 282	32,8%			
Öhman Global Hållbar A	10 182 981	12 111 161	15 632 845	29,1%			
Delsumma globala fonder	66 485 998	73 956 141	95 323 194	28,9%	19		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 684 400,00	3 195 600	19,0%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	3 836 000,00	4 194 400	9,3%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 975 680,00	3 026 000	1,7%			
Delsumma strukturerade prod	10 980 000	9 496 080	10 416 000	9,7%	2	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	141 534 307	151 506 172	191 281 684	26,3%	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	497 857 660	8,9%	100		

I marknadsvärde per 2019-10-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränt