

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

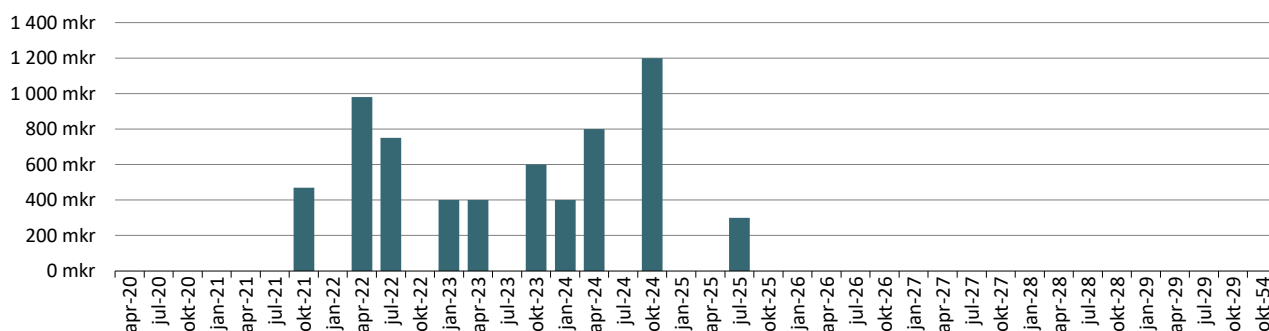
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 471 499	3 500 021	2 971 478
Swapvolym (tkr)	2 025 000	0	2 025 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	28 872	22 728	6 144
Snittränta exkl borgensavg	0,45%	0,65%	0,21%
Genomsnittlig marginal	0,12%	0,43%	-0,24%
Återstående räntebindningstid	1,21	0,77	1,72
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,37	2,03	2,76
Andel räntejustering inom 12 mån	69%	80%	56%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	34%	38%	28%

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	80 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 295 mkr	3 520 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

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR

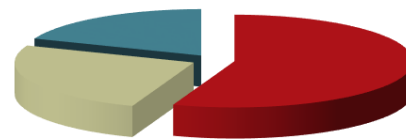


	Rambelopp (mkr)	2020-01-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 905	9 123
EVP	424	303
Certprogram	2 000	1 200
MTN-program	8 000	3 500

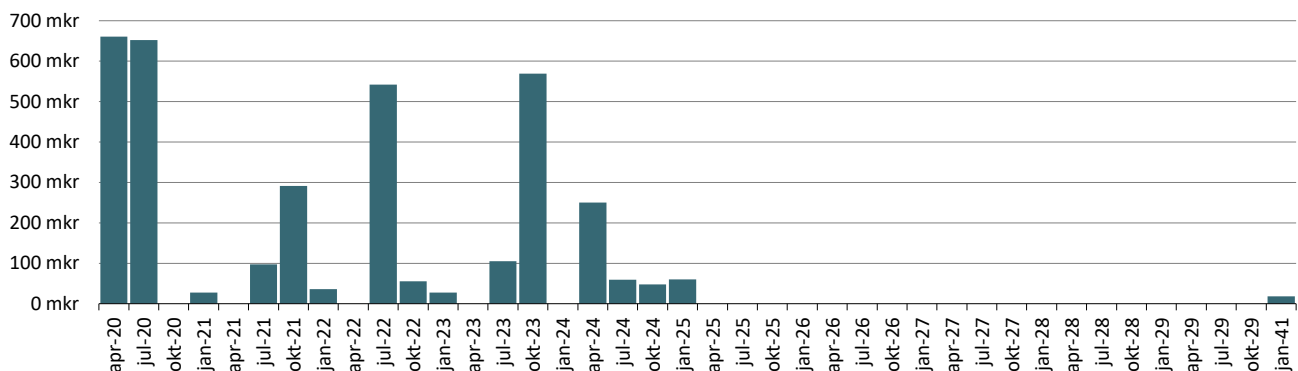
Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av outnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 500 000	6	56%
KI	1 600 000	4	25%
CERT	1 200 000	13	19%
Check	0	1	0%
Summa	6 300 000	24	100%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2020-01-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 900
LK Parkerings AB	400	138
Krafringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	811
Sydvatten	322	252
SVS	55	0

Koncernkontolimit

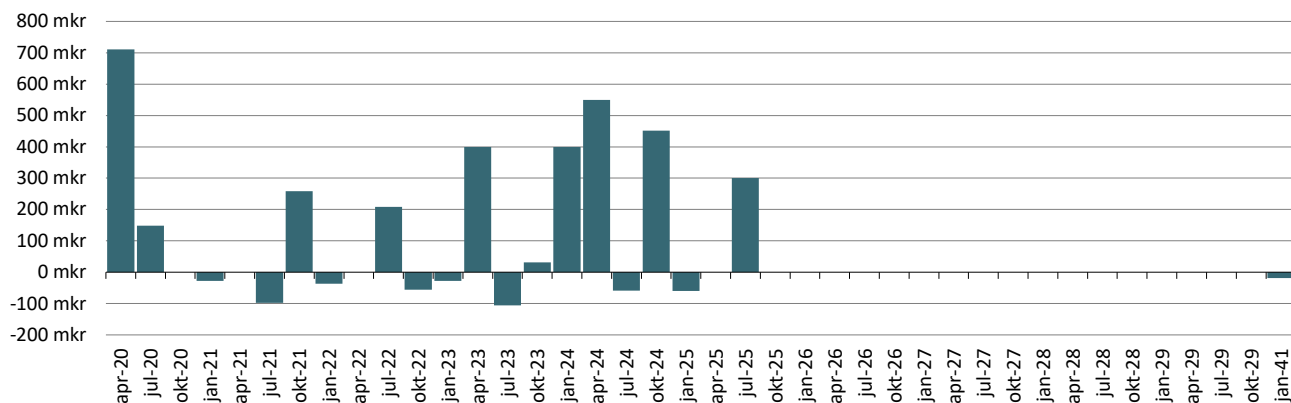
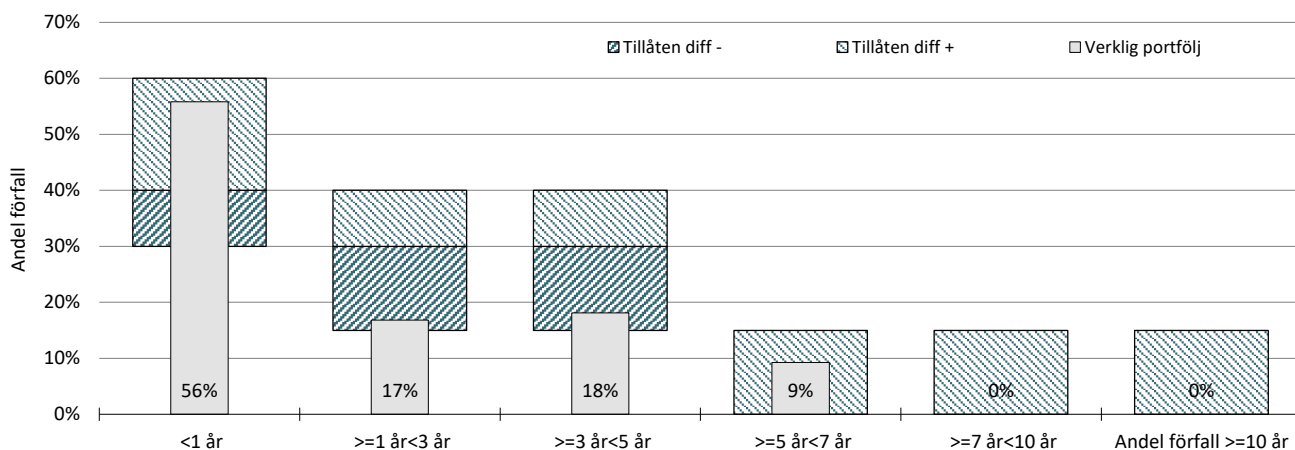
	Rambelopp (mkr)	2020-01-31
LKF	275	
LK Parkerings AB	100	38
Krafringen	120	0

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 500 000		2 500 000	71%
VA Syd	810 511		810 511	23%
Nordea		80 014	80 014	2%
LK Parkerings AB	37 907		37 907	1%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	1%
Div föreningar	11 107		11 107	0%
Övriga banker		6 183	6 183	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
Summa	3 413 825	86 197	3 500 021	100%



■ LKF ■ VA Syd
 ■ Nordea ■ LK Parkerings AB
 ■ Fast. AB Lund Arena ■ Kommuninvest
 ■ Div föreningar ■ Övriga banker
 ■ AF Borgen AB

4a. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDING

4b. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL RÄNTEBINDNING

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

Motpart	Volym	Värde	Gräns	Antal pos	% av exp	Snittvolym
SHB	425	2,2	-200	3	21%	142
SEB	150	1,5	-200	1	7%	150
Nordea	300	17,1	-200	1	15%	300
Danske	1150	6,5	-200	9	57%	128
Summa	2 025	27,3		14	100%	145

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Bas		27,1	24,2	23,9	22,1	23,1
Hög		28,2	30,4	37,9	44,8	55,1
Låg		26,1	19,2	12,3	2,7	-4,5
varav löftesprovision		3,7	3,7	3,7	3,7	3,7
Utgående nettoskuldvolym	2 669	3 093	3 435	3 667	3 667	3 667

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

<u>Tillgångsslag</u>	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2019-12-31	Marknadsvärde 2020-01-31	%-förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
						Lägst %	Högst %
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun		490 353 902	490 370 792	0,0%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun		-198 340 030	-198 346 862	0,0%			
Summa räntebärande placeringar		292 013 872	292 023 930	0,0%	55	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	31 722 552	33 036 067	33 375 996	1,0%			
Öhman Sverige Hållbar B	39 206 742	40 486 560	40 248 609	-0,6%			
SPP Sverige Plus B	24 111 440	25 257 013	25 544 157	1,1%			
Delsumma svenska fonder	95 040 734	98 779 640	99 168 762	0,4%	19		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 617 631	34 732 510	36 551 292	5,2%			
Robur Global Impact	10 002 611	10 045 728	10 403 472	3,6%			
SHB Global 90	31 990 946	40 160 076	41 241 140	2,7%			
SPP Global Plus A	10 047 504	17 496 640	18 226 655	4,2%			
Öhman Global Hållbar A	10 325 019	16 470 753	16 864 807	2,4%			
Delsumma globala fonder	86 983 711	118 905 707	123 287 366	3,7%	23		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	3 356 700,00	3 342 600	-0,4%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 196 400,00	4 233 600	0,9%			
Consensus Autocall	3 400 000	3 019 200,00	3 030 760	0,4%			
Delsumma strukturerade prod	10 980 000	10 572 300	10 606 960	0,3%	2	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	193 004 444	228 257 647	233 063 088	2,1%	44	30	50
Likvida medel							
Depåkonto Garantum		3 954 600	3 954 600				
Depåkonto Handelsbanken		1 099 587	1 099 587				
Delsumma		5 054 187	5 054 187	0,0%	1	0	10
Summa Pensionsmedel		525 325 706	530 141 205	0,9%	100		

I marknadsvärde per 2020-01-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.