

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 434 056	4 016 362	2 417 694
Swapvolym (tkr)	1 575 000	0	1 575 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	13 512	14 929	-1 417
Snittränta exkl borgensavg	0,21%	0,37%	-0,06%
Genomsnittlig marginal	0,14%	0,46%	-0,39%
Återstående räntebindningstid	1,1	0,9	1,45
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	1,97	2,22	1,55
Andel räntejustering inom 12 mån	63%	68%	55%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	46%	37%	60%

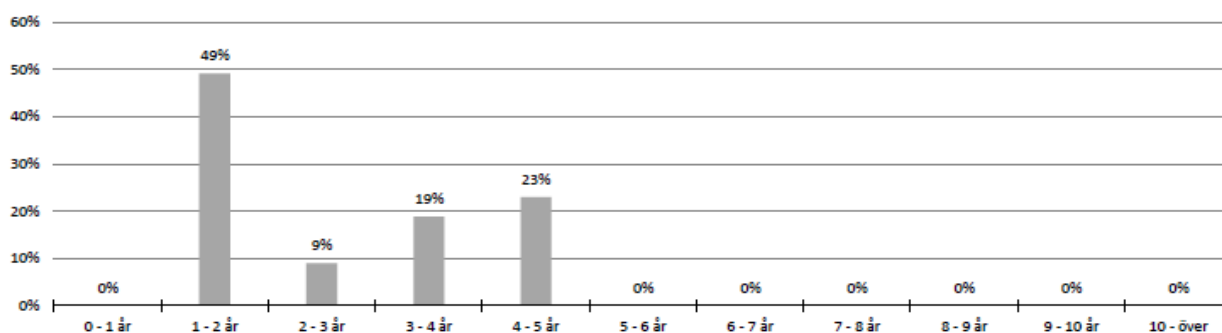
1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	194 Mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 981 Mkr	3 682 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

Inga avvikelser.

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR

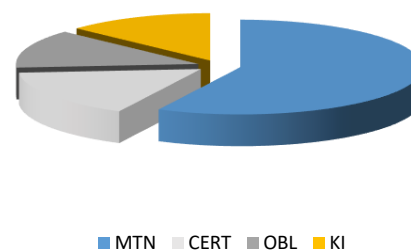


	Rambelopp (mkr)	2018-12-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 688	7 927
EVP	893	208
Certprogram	2 000	1 000
MTN-program	8 000	3 500

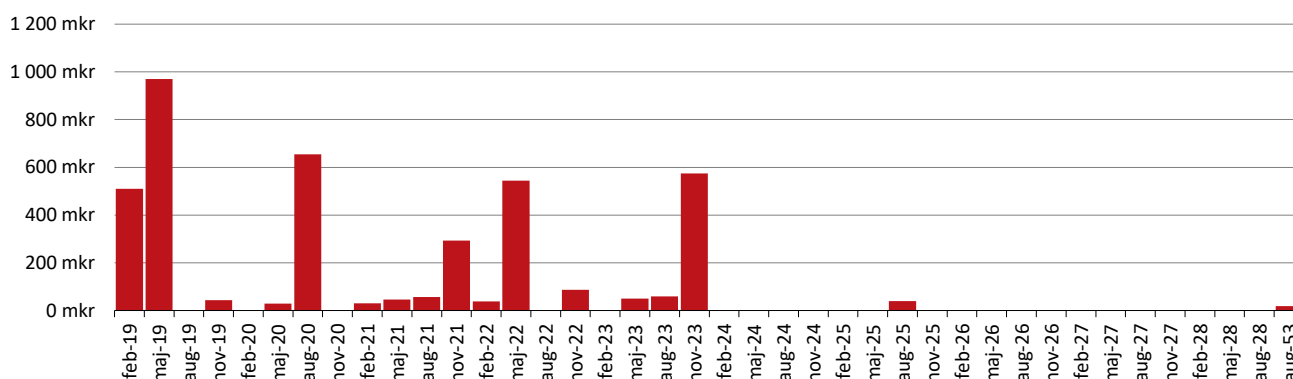
Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskas därmed av utnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING (skuld) - PER UPPLÅNINGSFORM

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 500 000	5	57%
CERT	1 000 000	9	16%
OBL	800 000	1	13%
KI	800 000	2	13%
CHECK	0	0	0%
Summa	6 100 000	17	100%



3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM



Utlånings- och borgensramar

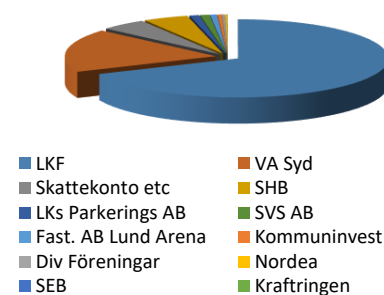
	Rambelopp (mkr)	2018-12-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 550
LK Parkering	400	46
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	719
Sydvatten	322	243
SVS	55	40

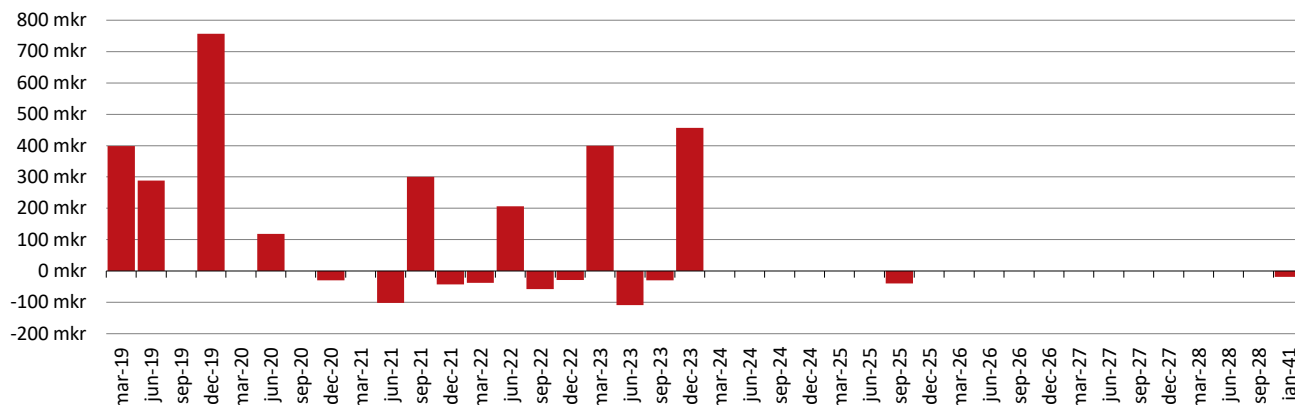
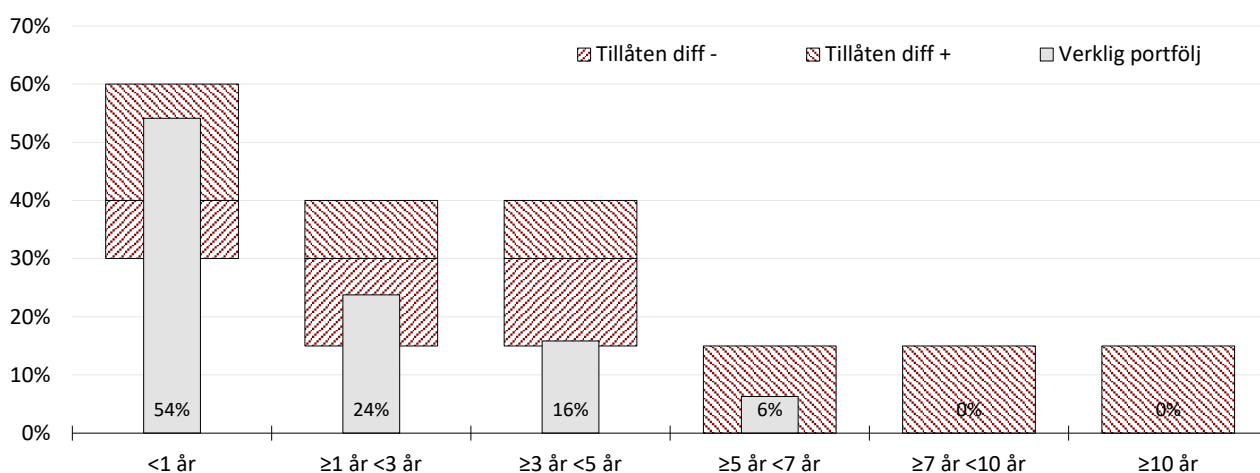
Koncernkontolimitier

	Rambelopp (mkr)	2018-12-31
LKF	175	
LK Parkering	100	46
Kraftringen	120	0

3b. UTLÅNING OCH KONTOSALDON (fordran) - PER MOTPART

Läntagare	Utlåning	Kontosaldo	Totalt	%
LKF	2 750 000	-	2 750 000	68%
VA Syd	719 299	-	719 299	18%
Skattekonto etc	-	199 004	199 004	5%
SHB	-	194 128	194 128	5%
LKs Parkerings AB	42 576	-	42 576	1%
SVS AB	40 000	-	40 000	1%
Fast. AB Lund Arena	30 000	-	30 000	1%
Kommuninvest	18 300	-	18 300	0%
Div Föreningar	11 812	-	11 812	0%
Nordea	-	9 292	9 292	0%
SEB	-	1 951	1 951	0%
Kraftringen	0	-	0	0%
Summa	3 611 987	404 375	4 016 362	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	8%	125
SHB	150	1,3	-200	1	10%	150
Nordea	400	25,3	-200	2	25%	200
Danske	900	3,6	-200	7	57%	129
Summa	1 575	30,7		11	100%	143

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Bas		9,5	18,2	25,0	34,5	41,7
Hög		9,5	20,2	34,9	57,9	79,6
Låg		9,5	16,2	16,5	15,3	9,5
Utgående nettoskuldvolym	1 987	2 418	2 999	3 489	3 923	3 923

5. PLACERINGAR - pensionsenheten

Tillgångsslag	Bokfört värde	Marknadsvärde		%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
		2017-12-31	2018-12-31			Lägst %	Högst %
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun	215 696 902	386 701 902	388 583 851	0,5%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-88 284 401	-157 487 219	-158 253 657	0,5%			
Summa räntebärande placeringar	127 412 501	229 214 683	230 330 194	0,5%	55	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Ethica Sverige	22 912 671	26 958 222	24 901 590	-7,6%			
Öhman Sverige Hållbar A	31 144 650	34 992 769	32 084 994	-8,3%			
SPP Sverige Plus	10 010 987	11 447 393	11 067 366	-3,3%			
Delsumma svenska fonder	64 068 308	73 398 384	68 053 951	-7,3%	16		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Ethica global	24 274 825	24 432 735	25 537 819	4,5%			
SHB Global 90	22 000 000	24 779 770	23 469 070	-5,3%			
SPP Global Plus	10 028 193	13 078 396	12 838 091	-1,8%			
Öhman Global Hållbar A	10 182 981	11 933 697	12 111 161	1,5%			
Delsumma globala fonder	66 485 998	74 224 598	73 956 141	-0,4%	18		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Vatten	3 300 000	3 564 300,00	3 129 600	-12,2%			
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 954 700,00	2 684 400	-9,1%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 168 000,00	3 836 000	-8,0%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 977 720,00	2 975 680	-0,1%			
Delsumma strukturerade prod	14 280 000	13 664 720	12 625 680	-7,6%	3	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	144 834 307	161 287 702	154 635 772	-4,1%	37	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	416 065 554	-1,3%	100		

I marknadsvärde per 2018-12-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.