

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

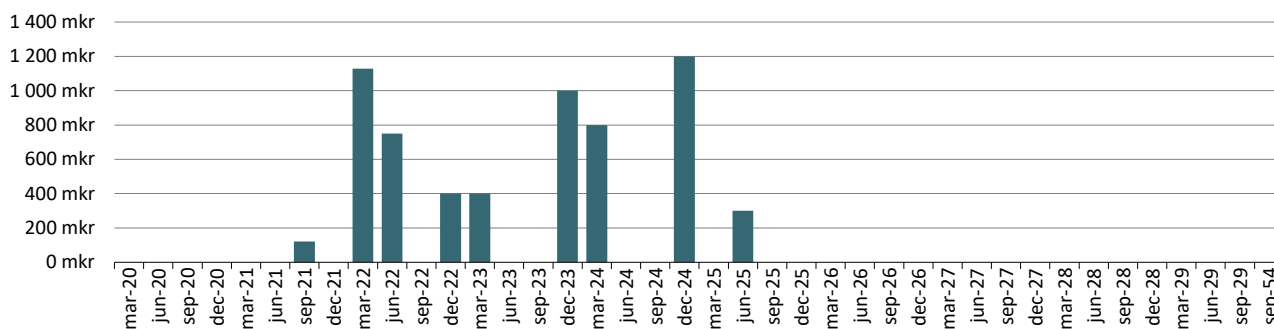
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 266 404	3 597 786	2 668 618
Swapvolym (tkr)	2 025 000	0	2 025 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	26 823	21 129	5 694
Snittränta exkl borgensavg	0,43%	0,59%	0,21%
Genomsnittlig marginal	0,13%	0,41%	-0,25%
Återstående räntebindningstid	1,25	0,80	1,86
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,50	2,05	3,11
Andel räntejustering inom 12 mån	68%	80%	51%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	31%	40%	20%

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	228 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	2 097 mkr	3 668 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

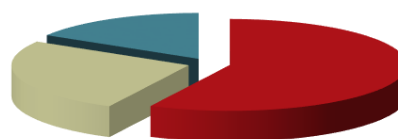


	Rambelopp (mkr)	2019-12-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 799	8 918
EVP	581	252
Certprogram	2 000	1 000
MTN-program	8 000	3 500

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

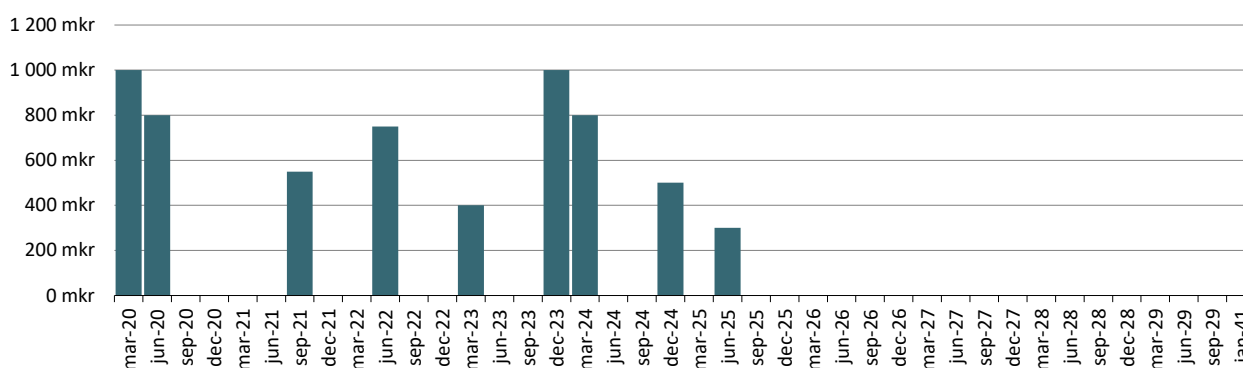
2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 500 000	6	57%
KI	1 600 000	4	26%
CERT	1 000 000	9	16%
Check	0	1	0%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

Summa	6 100 000	20	100%
--------------	------------------	-----------	-------------

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2019-12-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	4 650
LK Parkerings AB	400	137
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	811
Sydvatten	322	252
SVS	55	0

Koncernkontolimit

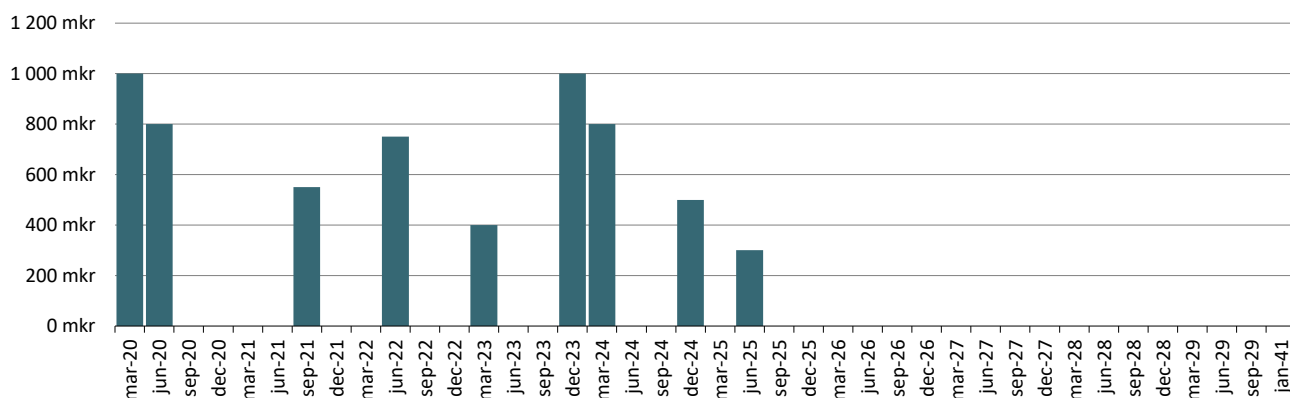
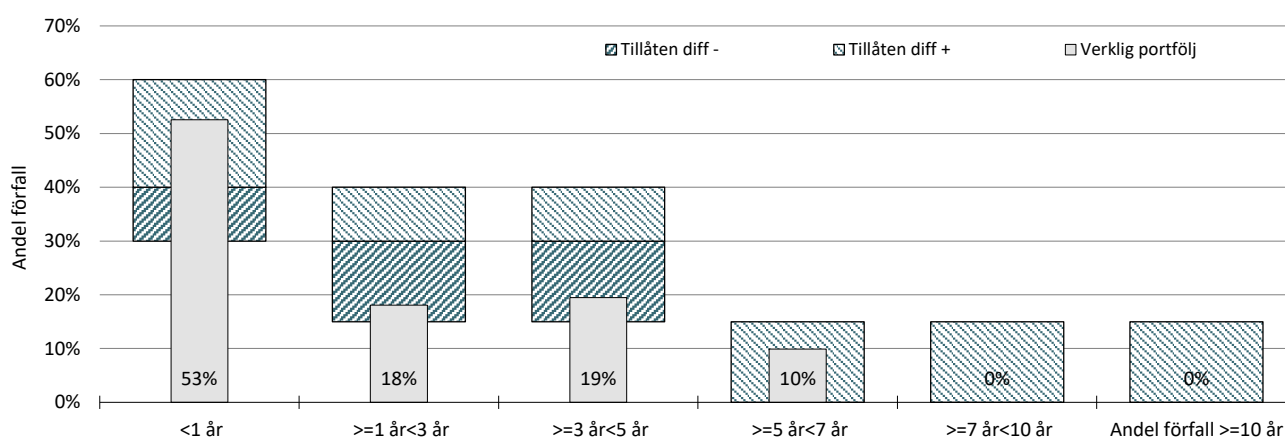
	Rambelopp (mkr)	2019-12-31
LKF	275	
LK Parkerings AB	100	37
Kraftringen	120	0

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 450 000		2 450 000	68%
VA Syd	810 511		810 511	23%
Nordea		228 462	228 462	6%
LK Parkerings AB	37 223		37 223	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	3 363 141	234 645	3 597 786	100%



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

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	-2,0	-200	3	21%	142
SEB	150	0,5	-200	1	7%	150
Nordea	300	17,3	-200	1	15%	300
Danske	1150	2,3	-200	9	57%	128
Summa	2 025	18,0		14	100%	145

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Bas		26,4	23,4	26,2	27,9	28,9
Hög		26,4	24,8	33,7	43,7	53,8
Låg		26,4	22,0	20,2	14,5	7,2
varav löftesprovision	2,7	3,7	3,7	3,7	3,7	3,7
Utgående nettoskuldvolym	2 417	2 669	3 093	3 435	3 667	3 667

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

<u>Tillgångsslag</u>	<u>Bokfört värde</u>	<u>Marknadsvärde 2018-12-31</u>	<u>Marknadsvärde 2019-12-31</u>	<u>%-förändring från årskiftet</u>	<u>Fördeln %</u>	<u>Placeringslimiter</u>	
						<u>Lägst %</u>	<u>Högst %</u>
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun	440 649 902	440 649 902	440 783 933	0,0%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun	-169 242 708	-169 242 708	-169 294 186	0,0%			
Summa räntebärande placeringar	271 407 194	271 407 194	271 489 747	0,0%	54	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	31 709 345	24 901 590	33 036 067	32,7%			
Öhman Sverige Hållbar B	39 111 799	32 084 994	40 486 560	26,2%			
SPP Sverige Plus B	14 109 259	11 067 366	14 823 448	33,9%			
SPP Sverige Plus B*	10 000 000	10 000 000	10 433 566	4,3%			
Delsumma svenska fonder	94 930 404	78 053 951	98 779 640	26,6%	20		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 545 222	25 537 819	34 732 510	36,0%			
Robur Global Impact*	10 000 000	10 000 000	10 045 728	0,5%			
SHB Global 90	22 000 000	23 469 070	29 924 344	27,5%			
SHB Global 90*	10 000 000	10 000 000	10 235 721	2,4%			
SPP Global Plus A	10 043 170	12 838 091	17 496 640	36,3%			
Öhman Global Hållbar A	10 292 917	12 111 161	16 470 753	36,0%			
Delsumma globala fonder	86 881 309	93 956 141	118 905 696	26,6%	24		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	2 684 400,00	3 356 700	25,0%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	3 836 000,00	4 196 400	9,4%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 975 680,00	3 019 200	1,5%			
Delsumma strukturerade prod	10 980 000	9 496 080	10 572 300	11,3%	2	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	192 791 713	181 506 172	228 257 636	25,8%	45	30	50
Likvida medel							
Depåkonto Garantum		3 129 600	3 954 600				
Depåkonto Handelsbanken		1 099 587	1 099 587				
Delsumma		4 229 187	5 054 187	19,5%	1	0	10
Summa Pensionsmedel		457 142 553	504 801 570	10,4%	100		

I marknadsvärde per 2019-12-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.

*Investeringen i dessa fonder gjordes 2019-12-03. Således visas endast förändring i marknadsvärdet för en knapp månad.