

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

| | Upplåning | Utlåning | Netto |
|---|-----------|-----------|-----------|
| Lånevolym (tkr) | 7 395 480 | 4 457 578 | 2 937 902 |
| Swapvolym (tkr) | 2 025 000 | 0 | 2 025 000 |
| Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg | 32 623 | 25 438 | 7 185 |
| Snittränta exkl borgensavg | 0,44% | 0,57% | 0,24% |
| Genomsnittlig marginal | 0,10% | 0,32% | -0,24% |
| Återstående räntebindningstid | 0,99 | 0,59 | 1,61 |
| Återstående kapitalbindningstid (exkl löften) | 2,17 | 1,49 | 3,19 |
| Andel räntejustering inom 12 mån | 73% | 84% | 56% |
| Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften) | 38% | 51% | 18% |

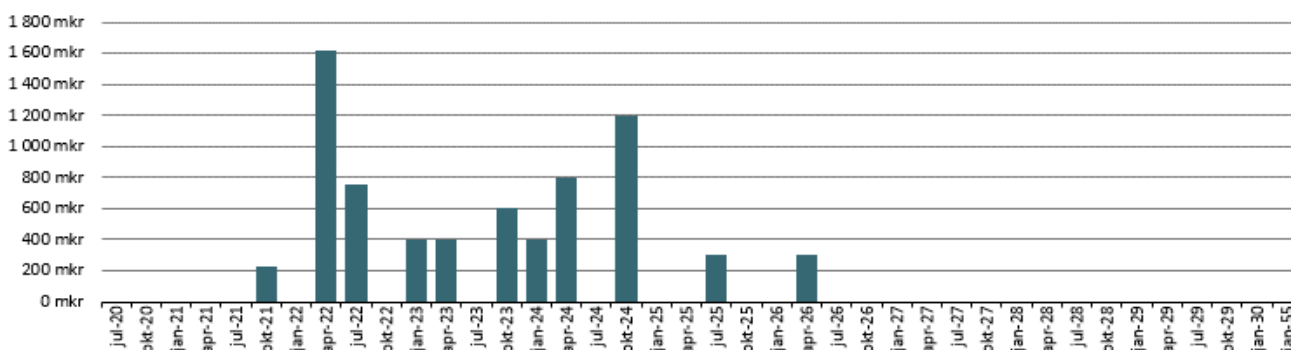
1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

| | Gräns | Utfall | OK/EJ OK |
|--|---------------------|----------|----------|
| Placering av överskottslikviditet per enskild motpart | 200 mkr | | OK |
| Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten | 500 mkr | 722 mkr | EJ OK |
| Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån) | 2692 mkr | 4143 mkr | OK |
| Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning) | Max >1 år | -0,7 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

På grund av turbulensen på de finansiella marknaderna som uppstod vid coronakrisen har både LKF och kommun utökat sin upplåning på certifikatmarknaden för att förstärka likviditeten vilket påverkar saldot på koncernkontot.

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR

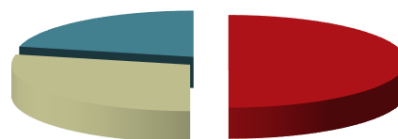


| | Rambelopp (mkr) | 2020-04-30 |
|--|-----------------|------------|
| Ram för upplåning i Lunds kommuns namn | 11 905 | 10 060 |
| EVP | 424 | 269 |
| Certprogram | 2 000 | 1 500 |
| MTN-program | 8 000 | 3 500 |

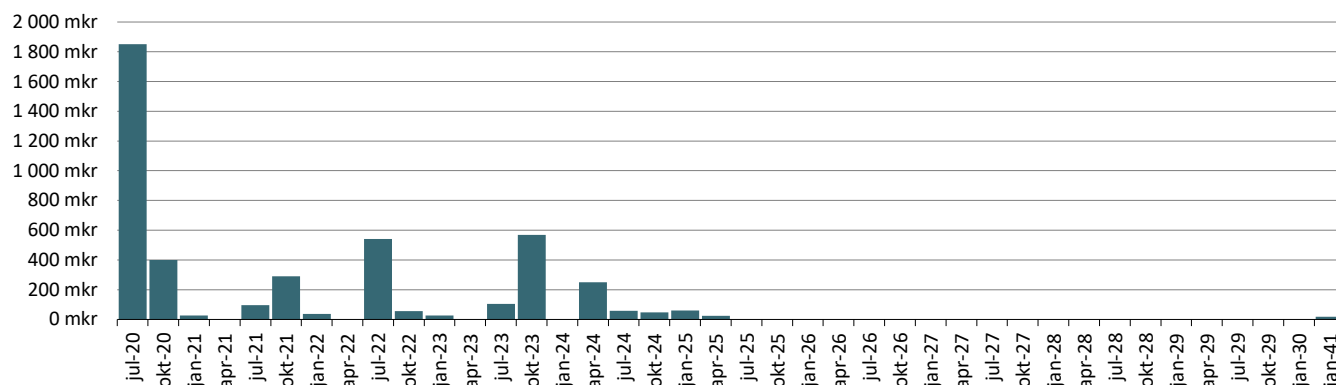
Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av outnyttjad löftesvolym förutsatt att löften har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

| Upplåningsform | Akt. skuld (tkr) | Antal pos | % av skuld |
|----------------|------------------|-----------|-------------|
| MTN | 3 500 000 | 6 | 50% |
| KI | 2 000 000 | 6 | 29% |
| CERT | 1 500 000 | 13 | 21% |
| Check | 0 | 1 | 0% |
| Summa | 7 000 000 | 26 | 100% |



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

| | Rambelopp (mkr) | 2020-04-30 |
|---|-----------------|------------|
| Majoritetsägda bolag | | |
| LKF | 7 000 | 5 200 |
| LK Parkerings AB | 400 | 160 |
| Kraftringen | - | - |
| Minoritetsägda bolag och kommunalförbund | | |
| VA Syd | 1 000 | 803 |
| Sydvatten | 322 | 265 |
| SVS | 55 | 0 |

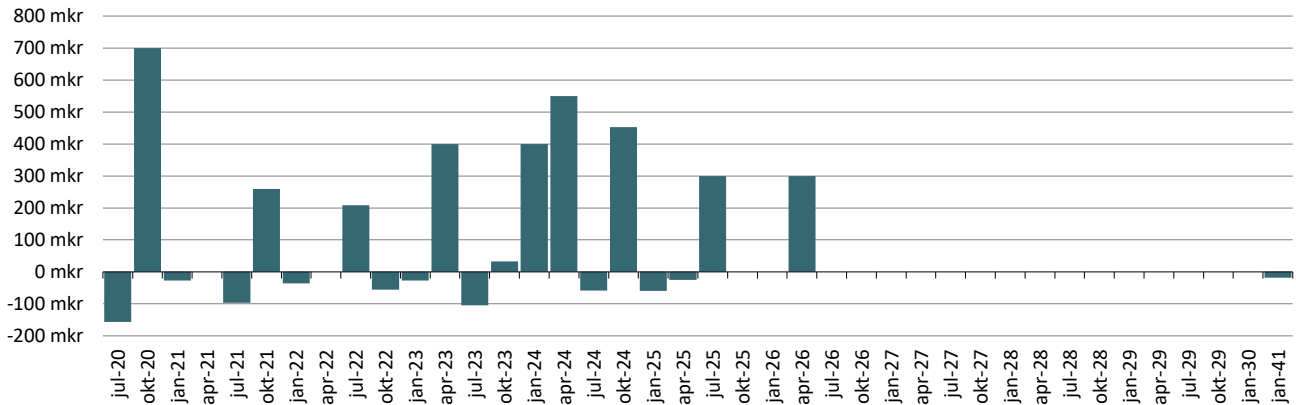
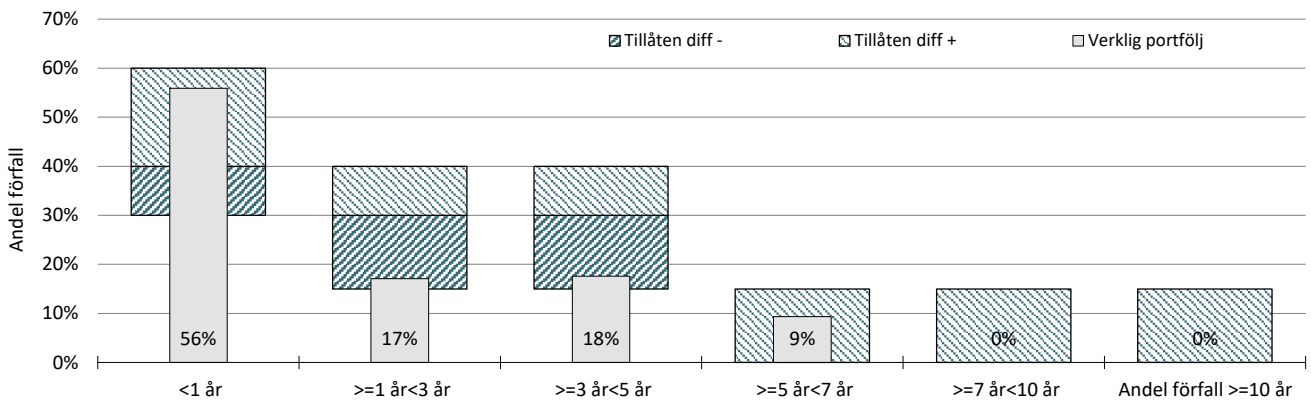
Koncernkontolimit

| | Rambelopp (mkr) | 2020-04-30 |
|------------------|-----------------|------------|
| LKF | 275 | |
| LK Parkerings AB | 100 | 60 |
| Kraftringen | 120 | 0 |

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

| Låntagare | Utlåning tkr | Kontosaldo tkr | Totalt tkr | % |
|---------------------|------------------|----------------|------------------|-------------|
| LKF | 2 800 000 | | 2 800 000 | 63% |
| VA Syd | 802 633 | | 802 633 | 18% |
| Nordea | | 721 780 | 721 780 | 16% |
| LK Parkerings AB | 59 690 | | 59 690 | 1% |
| Fast. AB Lund Arena | 30 000 | | 30 000 | 1% |
| Kommuninvest | 18 300 | | 18 300 | 0% |
| Div föreningar | 11 107 | | 11 107 | 0% |
| Övriga banker | | 8 069 | 8 069 | 0% |
| AF Borgen AB | 6 000 | | 6 000 | 0% |
| Summa | 3 727 729 | 729 849 | 4 457 578 | 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 | 3,6 | -200 | 3 | 21% | 142 |
| SEB | 150 | 1,8 | -200 | 1 | 7% | 150 |
| Nordea | 300 | 15,8 | -200 | 1 | 15% | 300 |
| Danske | 1150 | 8,5 | -200 | 9 | 57% | 128 |
| Summa | 2 025 | 29,8 | | 14 | 100% | 145 |

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

| | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 |
|-----------------------|------|------|------|------|------|------|
| Bas | | 25,4 | 22,1 | 21,1 | 18,8 | 19,0 |
| Hög | | 26,3 | 27,7 | 33,2 | 40,0 | 50,0 |
| Låg | | 24,5 | 16,4 | 9,3 | -0,3 | -8,2 |
| 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 2020-04-30 | %-förändring från årskiftet | Fördeln % | Placeringslimiter | |
|---|--------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|----------------------|--------------------------|----------------|
| | | | | | | Lägst % | Högst % |
| Räntebärande placeringar | | | | | | | |
| Återlån till Lunds kommun | | 490 353 902 | 490 353 902 | 0,0% | | | |
| Avräkningsskuld till Lunds kommun | | -198 340 030 | -198 340 030 | 0,0% | | | |
| <u>Summa räntebärande placeringar</u> | | 292 013 872 | 292 013 872 | 0,0% | 58 | 40 | 60 |
| Aktierelaterade placeringar | | | | | | | |
| <u>Svenska aktiefonder</u> | | | | | | | |
| Robur Transition Sweden Mega | 31 751 039 | 33 036 067 | 27 566 035 | -16,6% | | | |
| Öhman Sverige Hållbar B | 39 296 006 | 40 486 560 | 34 791 650 | -14,1% | | | |
| SPP Sverige Plus B | 24 114 425 | 25 257 013 | 22 280 358 | -11,8% | | | |
| Delsumma svenska fonder | 95 161 470 | 98 779 640 | 84 638 044 | -14,3% | 17 | | |
| <u>Globala aktiefonder</u> | | | | | | | |
| Robur Transition Global | 24 695 481 | 34 732 510 | 34 370 151 | -1,0% | | | |
| Robur Global Impact | 10 011 239 | 10 045 728 | 9 332 180 | -7,1% | | | |
| SHB Global Dynamisk 90 | 31 990 946 | 40 160 076 | 38 401 347 | -4,4% | | | |
| SPP Global Plus A | 10 051 765 | 17 496 640 | 16 264 787 | -7,0% | | | |
| Öhman Global Hållbar A | 10 356 478 | 16 470 753 | 15 375 272 | -6,7% | | | |
| Delsumma globala fonder | 87 105 909 | 118 905 707 | 113 743 737 | -4,3% | 23 | | |
| <u>Strukturerade produkter</u> | | | | | | | |
| Garantum Ny Energi | 3 300 000 | 3 356 700,00 | 2 997 900 | -10,7% | | | |
| Garantum Global Hållbarhet | 4 280 000 | 4 196 400,00 | 3 841 600 | -8,5% | | | |
| Consensus Autocall | 3 400 000 | 3 019 200,00 | 2 990 300 | -1,0% | | | |
| Delsumma strukturerade prod | 10 980 000 | 10 572 300 | 9 829 800 | -7,0% | 2 | 0 | 25 |
| <u>Summa aktierelaterade placeringar</u> | 193 247 379 | 228 257 647 | 208 211 581 | -8,8% | 41 | 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 | 505 279 640 | -3,8% | 100 | | |

I marknadsvärde per 2020-04-30 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.