

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 285 095	3 640 193	2 644 902
Swapvolym (tkr)	2 175 000	0	2 175 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	27 795	18 366	9 429
Snittränta exkl borgensavg	0,44%	0,50%	0,36%
Genomsnittlig marginal	0,09%	0,40%	-0,35%
Återstående räntebindningstid	1,14	0,81	1,59
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,31	1,79	3,01
Andel räntejustering inom 12 mån	67%	80%	49%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	27%	40%	9%

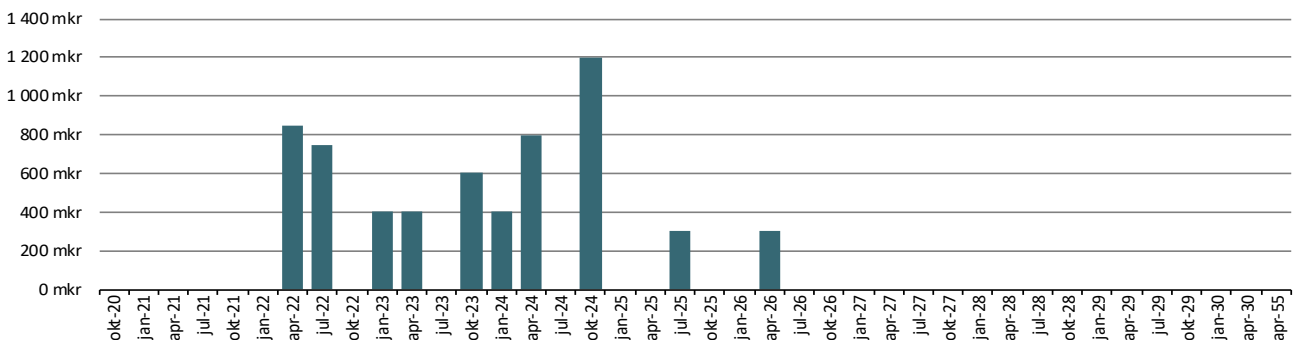
1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	547 mkr	EJ OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	1670 mkr	3984 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

Överskottslikviditeten på koncernkontot är fortfarande högre än mandatet i de finansiella riktlinjerna. En del av den extra upplåning som gjordes i samband med turbulensen på finansmarknaden i mars och april har amorterats av. Under juli månad betalade skatteverket ut en stor del av det kommunala stöd som har beslutats. För Lunds kommun innebar detta en utbetalning om ca 200 mnkr. Av den anledningen steg överskottslikviditeten igen över gränsen.

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR



	Rambelopp (mkr)	2020-07-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 905	9 650
EVP	424	-24
Certprogram	2 000	1 400
MTN-program	8 000	2 700

Diagramet 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.

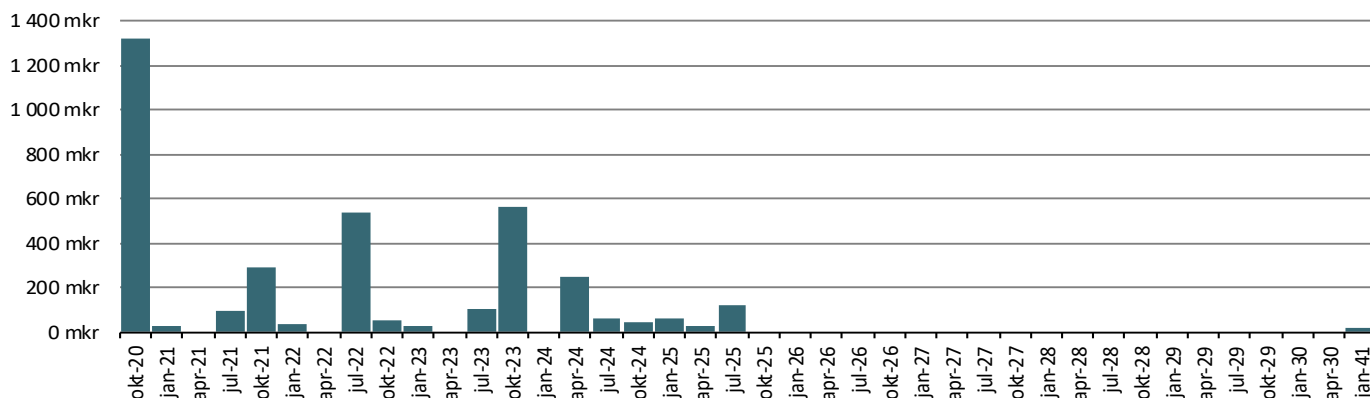
2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	2 700 000	5	45%
KI	1 900 000	5	32%
CERT	1 400 000	14	23%
Check	0	1	0%
<b>Summa</b>	<b>6 000 000</b>	<b>25</b>	<b>100%</b>



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM



Utlånings- och borgensramar

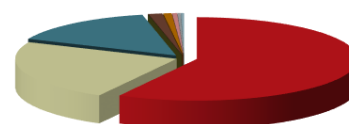
	Rambelopp (mkr)	2020-07-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	5 200
LK Parkerings AB	400	200
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	855
Sydvatten	322	265
SVS	55	11

Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2020-07-31
LKF	275	
LK Parkerings AB	100	0
Kraftringen AB	120	50

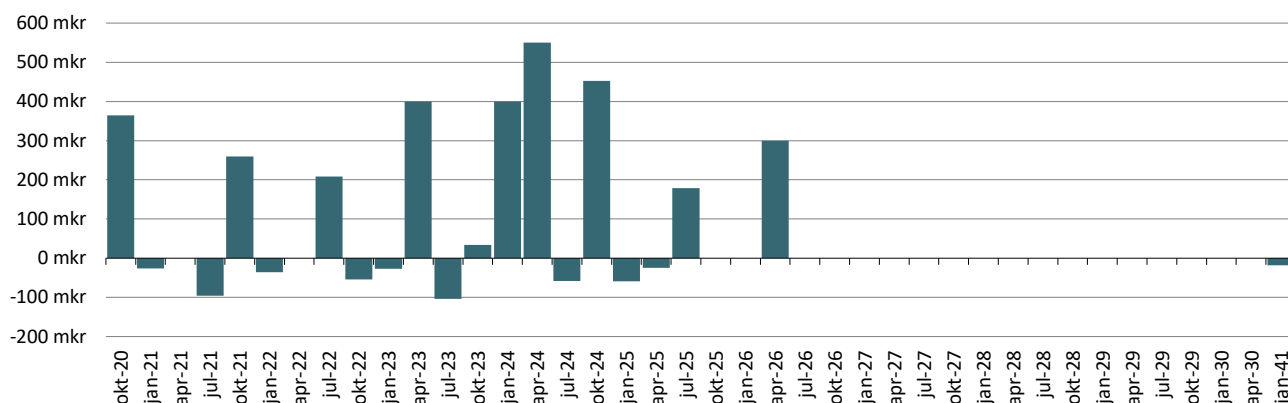
3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 100 000		2 100 000	58%
VA Syd	854 754		854 754	23%
Nordea		547 071	547 071	15%
LK Parkerings AB	0		0	0%
Kraftringen AB	50 403		50 403	1%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	1%
Div föreningar	10 905		10 905	0%
Övriga banker		12 260	12 260	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
SVS AB	10 500		10 500	0%
<b>Summa</b>	<b>3 080 862</b>	<b>559 331</b>	<b>3 640 193</b>	<b>100%</b>

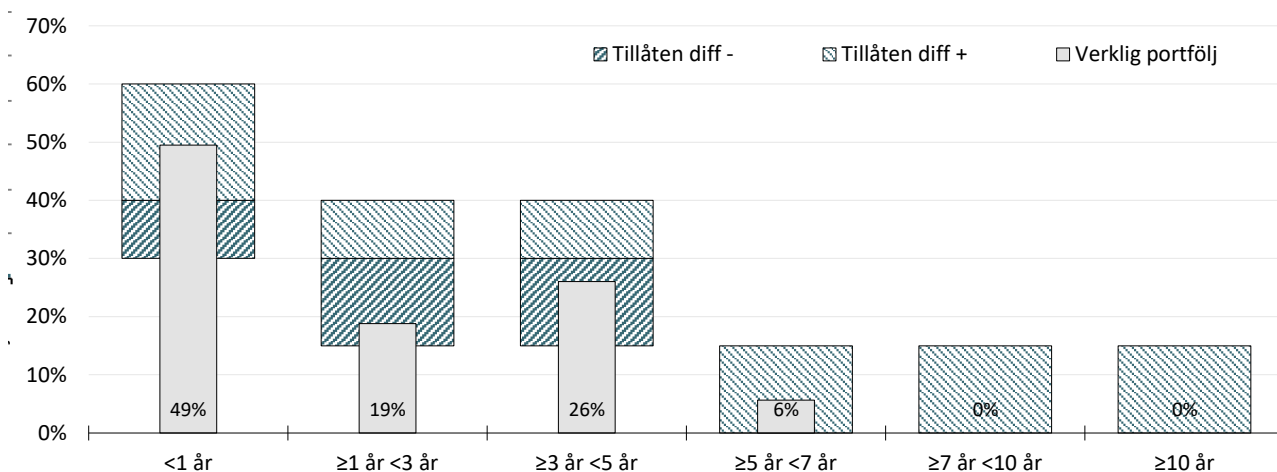


■ LKF ■ VA Syd  
 ■ Nordea ■ LK Parkerings AB  
 ■ Kraftringen AB ■ Fast. AB Lund Arena  
 ■ Kommuninvest ■ Div föreningar  
 ■ Övriga banker

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	4,4	-200	3	20%	142
SEB	150	2,0	-200	1	7%	150
Nordea	450	14,6	-200	2	21%	225
Danske	1150	9,7	-200	9	53%	128
<b>Summa</b>	<b>2 175</b>	<b>30,7</b>		<b>15</b>	<b>100%</b>	<b>145</b>

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Bas		25,2	20,6	19,5	17,1	16,8
Hög		25,5	24,8	29,6	35,1	44,2
Låg		24,9	16,4	10,0	0,9	-7,0
varav löftesprovision		3,7	3,7	3,7	3,7	3,7
<b>Utgående nettoskuldvolym</b>	<b>2 669</b>	<b>3 055</b>	<b>3 397</b>	<b>3 629</b>	<b>3 629</b>	<b>3 629</b>

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

Tillgångsslag	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2019-12-31	Marknadsvärde 2020-07-31	%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
						Lägst %	Högst %
<b>Räntebärande placeringar</b>							
Återlån till Lunds kommun		490 353 902	490 353 902	0,0%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun		-186 884 155	-186 884 155	0,0%			
<b>Summa räntebärande placeringar</b>		<b>303 469 747</b>	<b>303 469 747</b>	<b>0,0%</b>	<b>57</b>	<b>40</b>	<b>60</b>
<b>Aktierelaterade placeringar</b>							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	32 485 274	33 036 067	30 496 259	-7,7%			
Öhman Sverige Hållbar B	40 488 703	40 486 560	37 908 182	-6,4%			
SPP Sverige Plus B	25 339 450	25 257 013	25 216 432	-0,2%			
<b>Delsumma svenska fonder</b>	<b>98 313 427</b>	<b>98 779 640</b>	<b>93 620 872</b>	<b>-5,2%</b>	<b>18</b>		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 772 039	34 732 510	35 111 922	1,1%			
Robur Global Impact	10 019 357	10 045 728	9 191 884	-8,5%			
SHB Global Dynamisk 90 (A9)	31 990 946	40 160 076	38 273 061	-4,7%			
SPP Global Plus A	10 055 792	17 496 640	16 435 908	-6,1%			
Öhman Global Hållbar A	10 386 526	16 470 753	16 518 233	0,3%			
<b>Delsumma globala fonder</b>	<b>87 224 661</b>	<b>118 905 707</b>	<b>115 531 008</b>	<b>-2,8%</b>	<b>22</b>		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	3 356 700,00	3 459 600	3,1%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 196 400,00	3 826 000	-8,8%			
Consensus Autocall	3 400 000	3 019 200,00	2 980 780	-1,3%			
<b>Delsumma strukturerade prod</b>	<b>10 980 000</b>	<b>10 572 300</b>	<b>10 266 380</b>	<b>-2,9%</b>	<b>2</b>	<b>0</b>	<b>25</b>
<b>Summa aktierelaterade placeringar</b>	<b>196 518 088</b>	<b>228 257 647</b>	<b>219 418 260</b>	<b>-3,9%</b>	<b>42</b>	<b>30</b>	<b>50</b>
<b>Likvida medel</b>							
Depåkonto Garantum		3 954 600	3 954 600				
Depåkonto Handelsbanken		1 099 587	1 099 587				
<b>Delsumma</b>		<b>5 054 187</b>	<b>5 054 187</b>	<b>0,0%</b>	<b>1</b>	<b>0</b>	<b>10</b>
<b>Summa Pensionsmedel</b>		<b>536 781 581</b>	<b>527 942 194</b>	<b>-1,6%</b>	<b>100</b>		

I marknadsvärde per 2020-07-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.