

## 1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

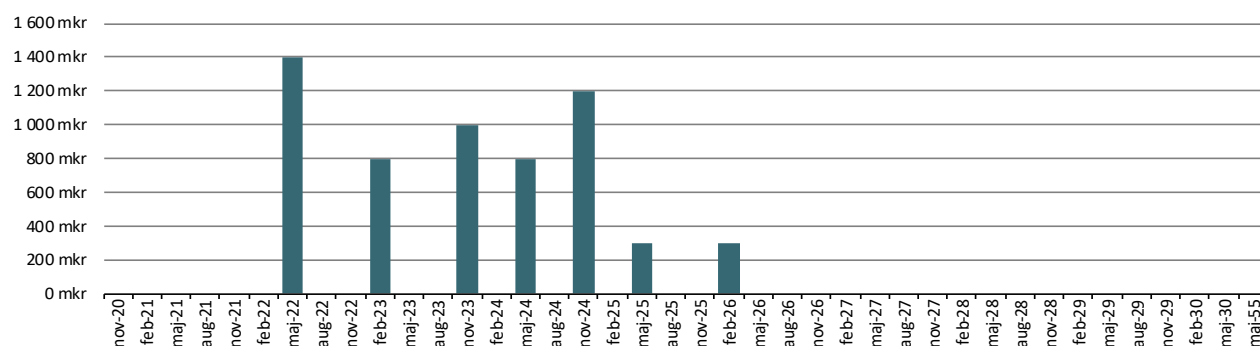
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 024 735	3 321 083	2 703 652
Swapvolym (tkr)	2 175 000	0	2 175 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	22 040	16 646	5 394
Snittränta exkl borgensavg	0,37%	0,50%	0,20%
Genomsnittlig marginal	0,11%	0,44%	-0,29%
Återstående räntebindningstid	1,23	0,82	1,73
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,35	1,89	2,91
Andel räntjustering inom 12 mån	66%	78%	51%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	24%	34%	11%

## 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	323 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	1474 mkr	3767 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 &amp; UPPLÅNINGSRAMAR



	Rambelopp (mkr)	2020-08-31
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 905	9 333
EVP	424	35
Certprogram	2 000	1 200
MTN-program	8 000	2 700

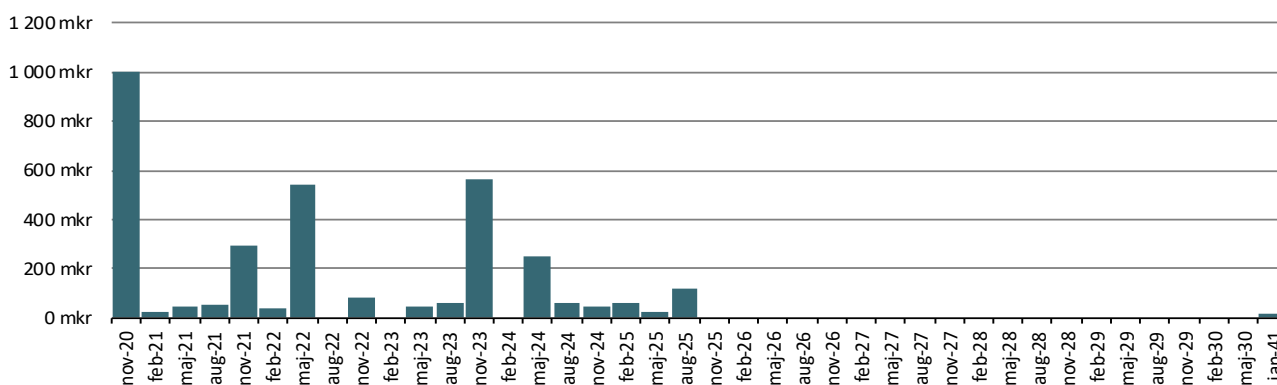
Diagrammet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av utnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

**2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER**

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	2 700 000	5	47%
KI	1 900 000	5	33%
CERT	1 200 000	11	21%
Check	0	1	0%
<b>Summa</b>	<b>5 800 000</b>	<b>22</b>	<b>100%</b>



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

**3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM**

**Utlånings- och borgensramar**

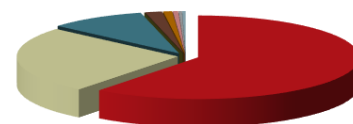
	Rambelopp (mkr)	2020-08-31
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	5 100
LK Parkerings AB	400	200
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	855
Sydvatten	322	265
SVS	55	11

**Koncernkontolimit**

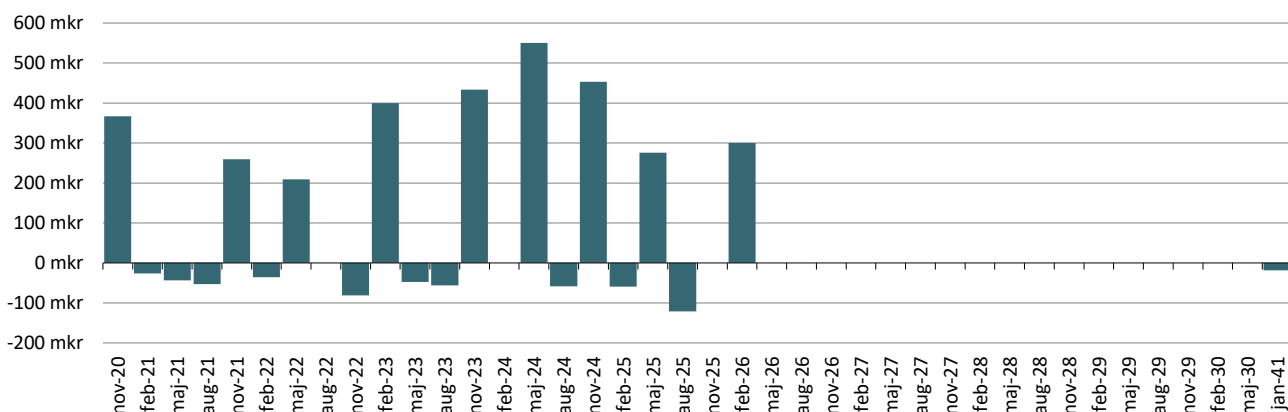
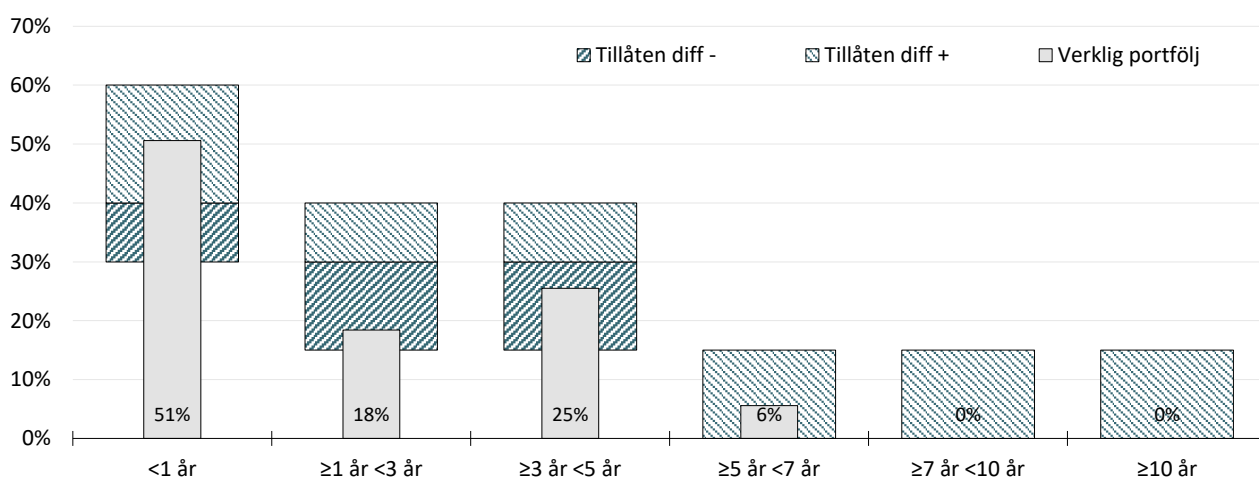
	Rambelopp (mkr)	2020-08-31
LKF	275	
LK Parkerings AB	110	0
Kraftringen AB	120	56

**3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE**

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 000 000		2 000 000	60%
VA Syd	854 754		854 754	26%
Nordea		322 915	322 915	10%
LK Parkerings AB	0		0	0%
Kraftringen AB	56 132		56 132	2%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest	18 300		18 300	1%
Div föreningar	10 870		10 870	0%
Övriga banker		11 612	11 612	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
SVS AB	10 500		10 500	0%
<b>Summa</b>	<b>2 986 556</b>	<b>334 527</b>	<b>3 321 083</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	4,2	-200	3	20%	142
SEB	150	2,1	-200	1	7%	150
Nordea	450	14,1	-200	2	21%	225
Danske	1150	10,0	-200	9	53%	128
<b>Summa</b>	<b>2 175</b>	<b>30,3</b>		<b>15</b>	<b>100%</b>	<b>145</b>

**4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS**

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Bas		20,8	21,6	19,6	19,8	21,9
Hög		20,9	25,0	29,0	37,9	51,2
Låg		20,7	18,3	11,0	3,8	-3,4
varav löftesprovision		3,7	3,7	3,7	3,7	3,7

<b>Utgående nettoskuldvolym</b>	<b>2 669</b>	<b>2 841</b>	<b>3 270</b>	<b>3 552</b>	<b>3 823</b>	<b>3 823</b>
---------------------------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------

## 5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

<u>Tillgångsslag</u>	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2019-12-31	Marknadsvärde 2020-08-31	%-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	32 079 966	-2,9%			
Öhman Sverige Hållbar B	40 488 703	40 486 560	39 366 189	-2,8%			
SPP Sverige Plus B	25 339 450	25 257 013	25 984 669	2,9%			
<b>Delsumma svenska fonder</b>	<b>98 313 427</b>	<b>98 779 640</b>	<b>97 430 824</b>	<b>-1,4%</b>	<b>18</b>		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 772 039	34 732 510	37 345 237	7,5%			
Robur Global Impact	10 019 357	10 045 728	9 645 637	-4,0%			
SHB Global Dynamisk 90 (A9)	31 990 946	40 160 076	38 724 979	-3,6%			
SPP Global Plus A	10 055 792	17 496 640	17 472 976	-0,1%			
Öhman Global Hållbar A	10 386 526	16 470 753	16 582 210	0,7%			
<b>Delsumma globala fonder</b>	<b>87 224 661</b>	<b>118 905 707</b>	<b>119 771 039</b>	<b>0,7%</b>	<b>22</b>		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	3 356 700,00	3 684 900	9,8%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 196 400,00	3 850 800	-8,2%			
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>10 516 480</b>	<b>-0,5%</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>227 718 342</b>	<b>-0,2%</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>536 242 277</b>	<b>-0,1%</b>	<b>100</b>		

I marknadsvärde per 2020-08-31 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.