

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 496 342	3 813 639	2 682 703
Swapvolym (tkr)	2 175 000	0	2 175 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	23 345	16 587	6 758
Snittränta exkl borgensavg	0,36%	0,43%	0,25%
Genomsnittlig marginal	0,12%	0,42%	-0,31%
Återstående räntebindningstid	1,06	0,72	1,55
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,44	1,85	3,28
Andel räntjustering inom 12 mån	70%	81%	
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	31%	43%	15%

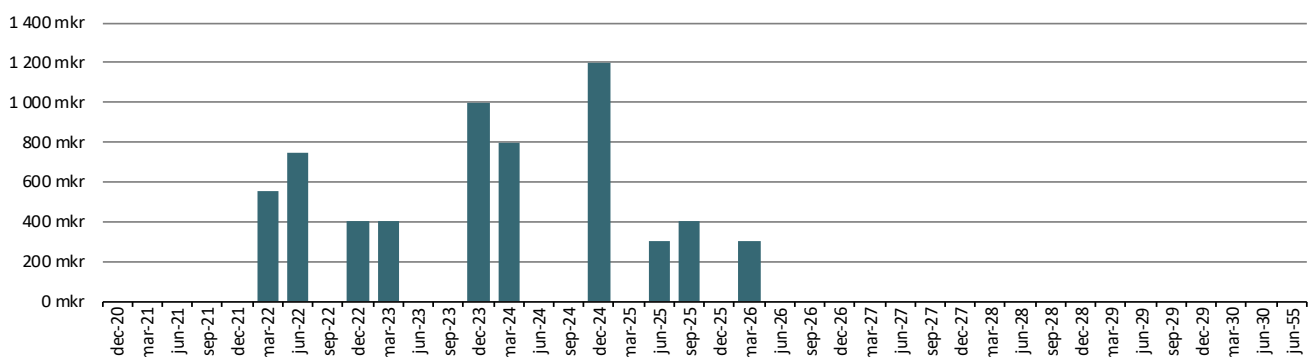
1b. UPPFÖLJNING AV DE FINANSIELLA RIKTLINJERNA

	Gräns	Utfall	OK/EJ OK
Placering av överskottslikviditet per enskild motpart	200 mkr		OK
Placering av överskottslikviditet på koncernkonto eller svenska staten	500 mkr	682 mkr	EJ OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller låneförfall + 50 % nyupplåning 12 mån)	1936 mkr	4131 mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	-0,6 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

En emission av en grön obligation om 400 mnkr med löptid 5 år gjordes den 25 september. För att möta detta inflöde kommer upplåning via certifikatmarknaden att minska vid nästa förfall som är i oktober. Därmed kommer volymen på koncernkontot att hamna innanför mandat.

2a. EXTERN UPPLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & UPPLÅNINGSRAMAR

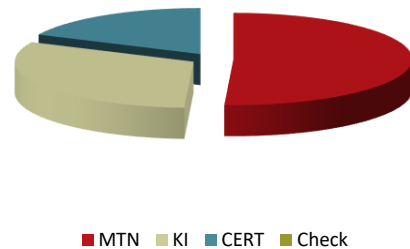
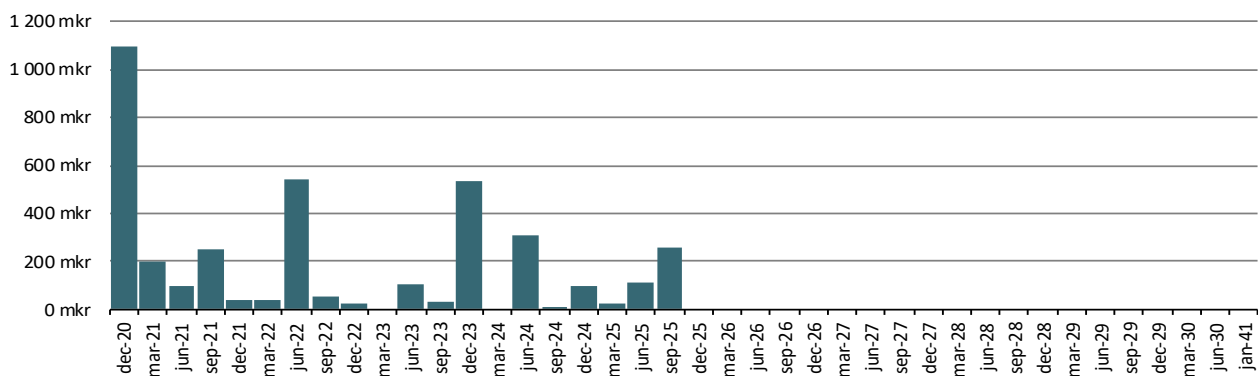


	Rambelopp (mkr)	2020-09-30
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 905	9 861
EVP	424	14
Certprogram	2 000	1 100
MTN-program	8 000	3 100

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	3 100 000	6	51%
KI	1 900 000	5	31%
CERT	1 100 000	8	18%
Check	0	1	0%
Summa	6 100 000	20	100%


3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

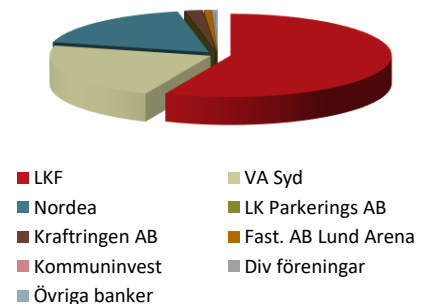
	Rambelopp (mkr)	2020-09-30
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	5 250
LK Parkerings AB	400	200
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	846
Sydvatten	322	265
SVS	55	11

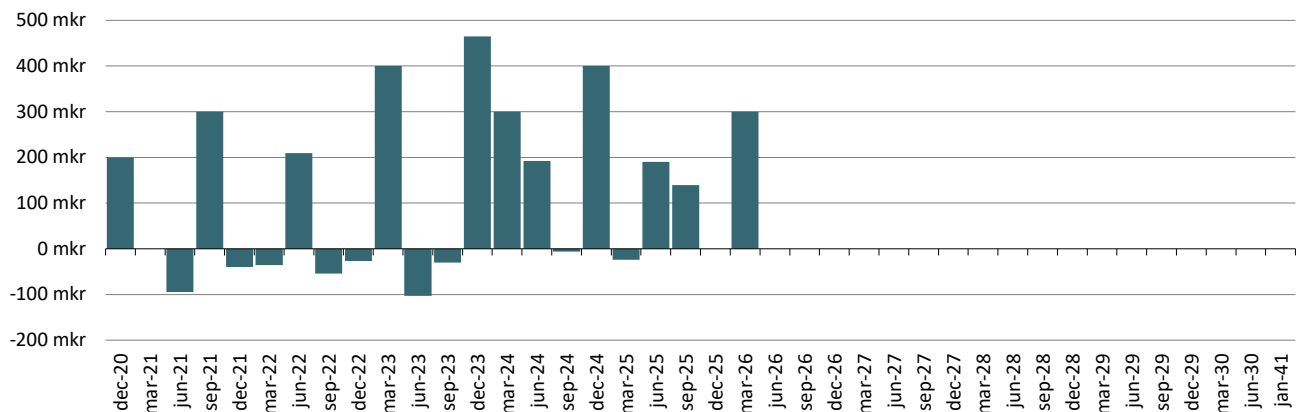
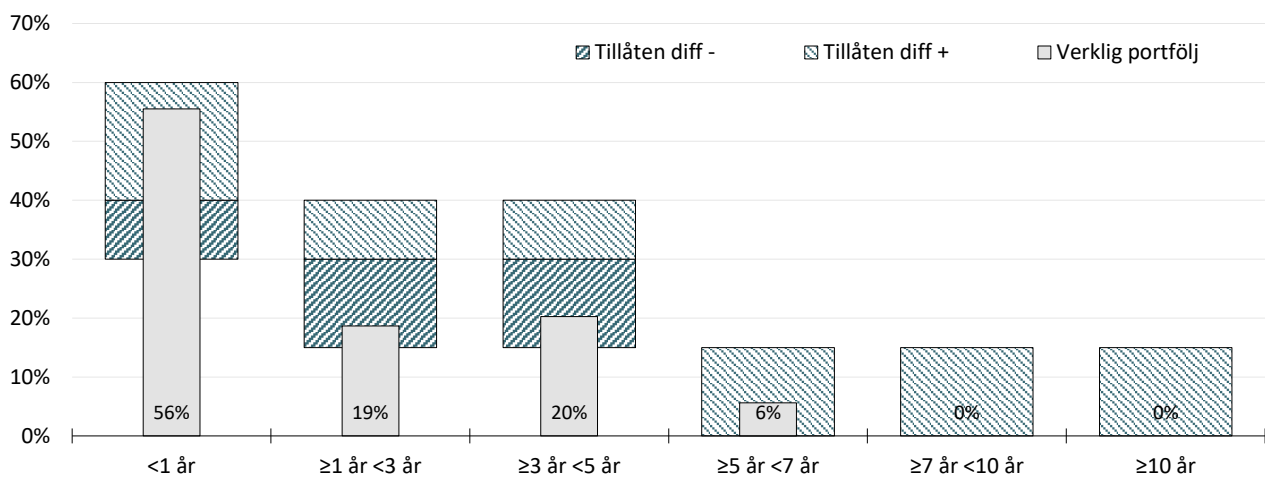
Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2020-09-30
LKF	275	
LK Parkerings AB	110	0
Kraftringen AB	120	67

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 150 000		2 150 000	56%
VA Syd	846 420		846 420	22%
Nordea		682 395	682 395	18%
LK Parkerings AB	0		0	0%
Kraftringen AB	67 267		67 267	2%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest			0	0%
Div föreningar	10 870		10 870	0%
Övriga banker		10 187	10 187	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
SVS AB	10 500		10 500	0%
Summa	3 121 057	692 582	3 813 639	100%



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	5,4	-200	3	20%	142
SEB	150	2,3	-200	1	7%	150
Nordea	450	14,0	-200	2	21%	225
Danske	1150	10,9	-200	9	53%	128
Summa	2 175	32,6		15	100%	145

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Bas		22,0	21,1	18,6	17,3	17,5
Hög		22,0	23,8	26,6	33,1	43,7
Låg		22,0	18,6	11,3	3,3	-4,9
varav löftesprovision		3,7	3,7	3,7	3,7	3,7

Utgående nettoskuldvolym	2 669	2 751	3 180	3 462	3 733	3 733
---------------------------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

<u>Tillgångsslag</u>	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2019-12-31	Marknadsvärde 2020-09-30	%-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		-186 884 155	-186 884 155	0,0%			
Summa räntebärande placeringar		303 469 747	303 469 747	0,0%	56	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	32 485 274	33 036 067	33 307 157	0,8%			
Öhman Sverige Hållbar B	40 488 703	40 486 560	41 138 369	1,6%			
SPP Sverige Plus B	25 339 450	25 257 013	27 277 734	8,0%			
Delsumma svenska fonder	98 313 427	98 779 640	101 723 260	3,0%	19		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 772 039	34 732 510	38 003 881	9,4%			
Robur Global Impact	10 019 357	10 045 728	10 041 886	0,0%			
SHB Global Dynamisk 90 (A9)	31 990 946	40 160 076	38 821 193	-3,3%			
SPP Global Plus A	10 055 792	17 496 640	17 699 481	1,2%			
Öhman Global Hållbar A	10 386 526	16 470 753	16 667 125	1,2%			
Delsumma globala fonder	87 224 661	118 905 707	121 233 566	2,0%	22		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	3 356 700,00	3 709 800	10,5%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 196 400,00	3 885 200	-7,4%			
Consensus Autocall	3 400 000	3 019 200,00	2 980 780	-1,3%			
Delsumma strukturerade prod	10 980 000	10 572 300	10 575 780	0,0%	2	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	196 518 088	228 257 647	233 532 606	2,3%	43	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		536 781 581	542 056 540	1,0%	100		

I marknadsvärde per 2020-09-30 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.