

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

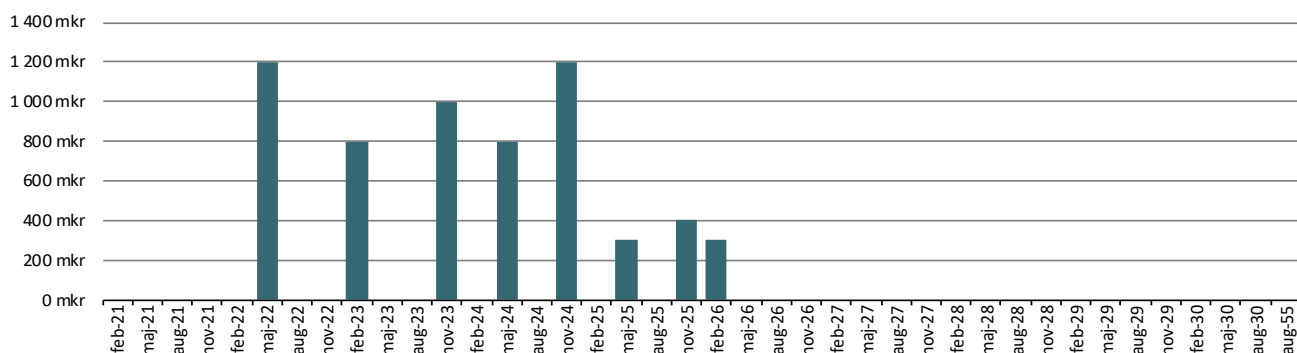
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 297 108	3 617 132	2 679 976
Swapvolym (tkr)	2 475 000	0	2 475 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	16 624	15 614	1 010
Snittränta exkl borgensavg	0,26%	0,43%	0,04%
Genomsnittlig marginal	0,12%	0,45%	-0,32%
Återstående räntebindningstid	1,30	0,77	2,02
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,38	1,90	3,03
Andel räntejustering inom 12 mån	65%	79%	45%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	29%	39%	16%

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	370 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller samlade låneförfall inom en 12-mån perio	2000 mkr	2995 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

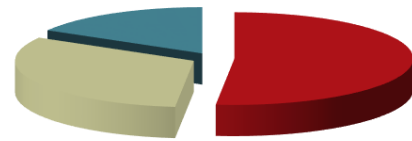


	Rambelopp (mkr)	2020-11-30
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	11 905	9 662
EVP	424	11
Certprogram	2 000	1 000
MTN-program	8 000	3 100

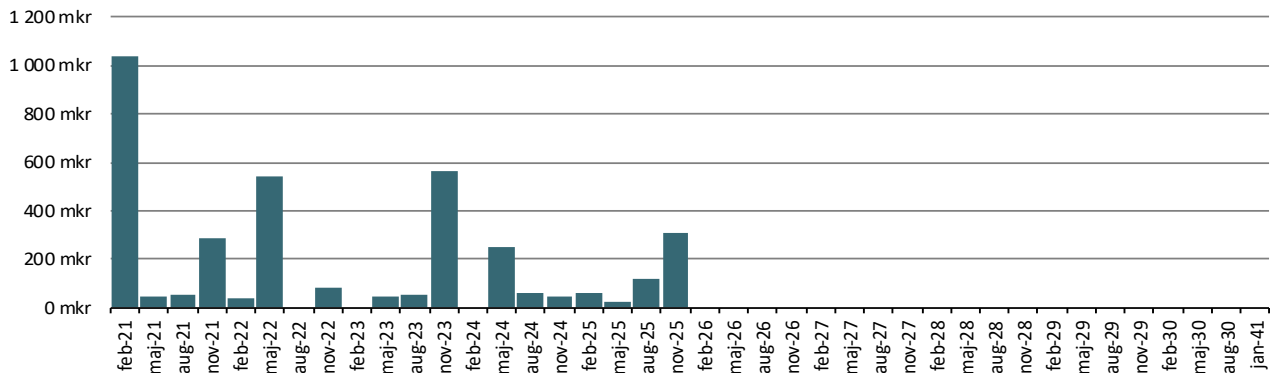
Diagramet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskar därmed av outnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 100 000	6	52%
KI	1 900 000	5	32%
CERT	1 000 000	8	17%
Check	0	1	0%
Summa	6 000 000	20	100%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2020-11-30
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	5 250
LK Parkerings AB	400	241
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	906
Sydvatten	393	265
SVS	55	11

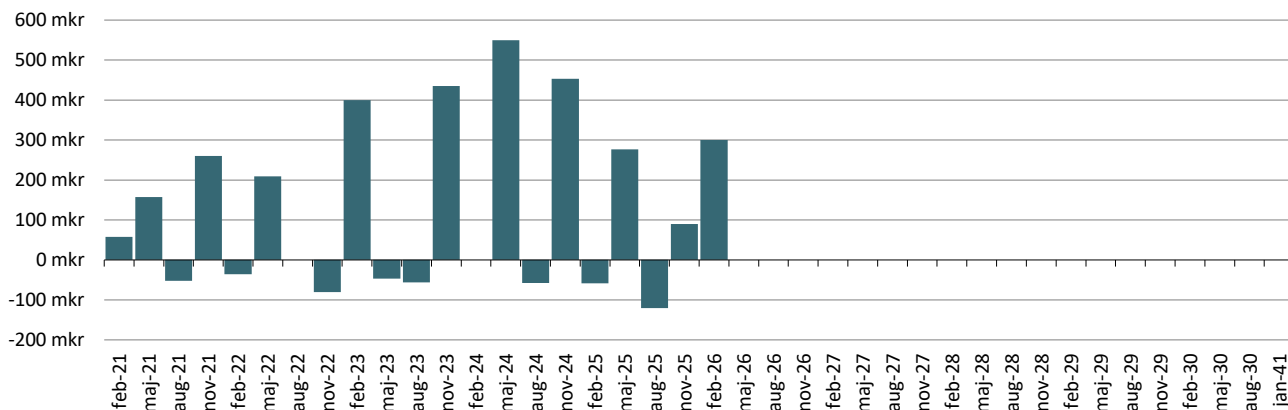
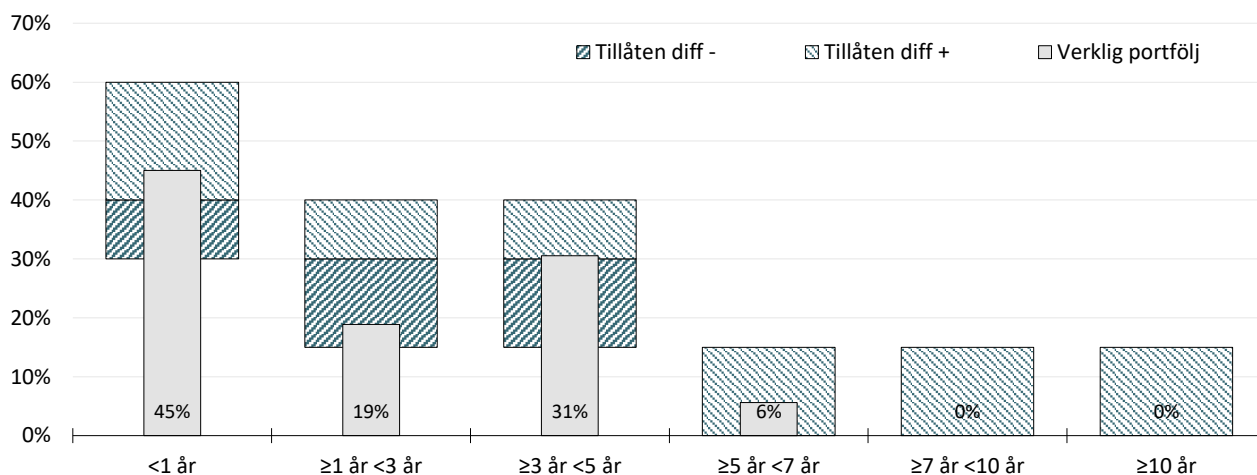
Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2020-11-30
LKF	275	
LK Parkerings AB	110	41
Kraftringen AB	120	81

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 150 000		2 150 000	59%
VA Syd	906 420		906 420	25%
Nordea		370 360	370 360	10%
LK Parkerings AB	41 108		41 108	1%
Kraftringen AB	81 179		81 179	2%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest		0	0	0%
Div föreningar	10 870		10 870	0%
Övriga banker		10 694	10 694	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
SVS AB	10 500		10 500	0%
Summa	3 236 078	381 054	3 617 132	100%


 ■ 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	4,8	-200	3	17%	142
SEB	150	2,2	-200	1	6%	150
Nordea	350	8,5	-200	2	14%	175
Danske	1350	9,7	-200	10	55%	135
Swedbank	200	0,0	-200	1	8%	200
Summa	2 475	25,2		17	100%	146

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Bas		21,8	18,5	16,7	17,7	18,6
Hög		21,8	20,4	23,0	30,5	40,3
Låg		21,8	16,6	10,8	6,2	-0,1
varav löftesprovision		3,7	3,7	3,7	3,7	3,7

Utgående nettoskuldvolym	2 669	2 769	3 198	3 480	3 751	3 751
---------------------------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------

5. PLACERINGAR - PENSIONSENHETEN

<u>Tillgångsslag</u>	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2019-12-31	Marknadsvärde 2020-11-30	%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%			
<u>Summa räntebärande placeringar</u>		303 469 747	303 469 747	0,0%	55	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	32 485 274	33 036 067	34 317 924	3,9%			
Öhman Sverige Hållbar B	40 488 703	40 486 560	43 326 349	7,0%			
SPP Sverige Plus B	25 342 698	25 257 013	28 683 812	13,6%			
Delsumma svenska fonder	98 316 675	98 779 640	106 328 085	7,6%	19		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 772 039	34 732 510	39 147 695	12,7%			
Robur Global Impact	10 019 357	10 045 728	10 357 937	3,1%			
SHB Global Dynamisk 90 (A9)	31 990 946	40 160 076	39 019 454	-2,8%			
SPP Global Plus A	10 060 085	17 496 640	18 259 743	4,4%			
Öhman Global Hållbar A	10 386 526	16 470 753	17 690 365	7,4%			
Delsumma globala fonder	87 228 954	118 905 707	124 475 193	4,7%	23		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Ny Energi	3 300 000	3 356 700,00	4 201 500	25,2%			
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	4 196 400,00	3 914 800	-6,7%			
Consensus Autocall	3 400 000	3 019 200,00	3 033 820	0,5%			
Delsumma strukturerade prod	10 980 000	10 572 300	11 150 120	5,5%	2	0	25
<u>Summa aktierelaterade placeringar</u>	196 525 629	228 257 647	241 953 398	6,0%	44	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	550 477 332	2,6%	100		

I marknadsvärde per 2020-11-30 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.