

1a. BASFAKTA OCH NYCKELTAL (momentant)

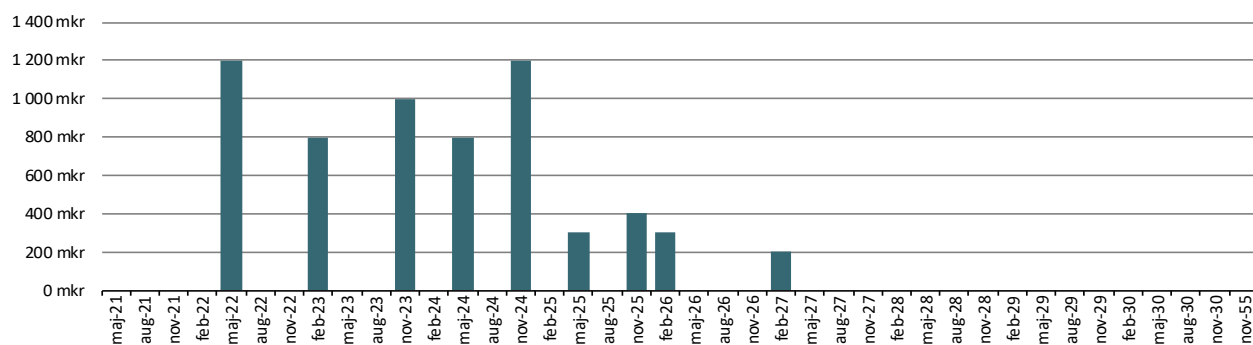
	Upplåning	Utlåning	Netto
Lånevolym (tkr)	6 508 112	3 704 858	2 803 254
Swapvolym (tkr)	2 275 000	0	2 275 000
Räntekostnad (tkr) exkl borgensavg	12 919	15 042	-2 122
Snittränta exkl borgensavg	0,20%	0,41%	-0,08%
Genomsnittlig marginal	0,12%	0,44%	-0,30%
Återstående räntebindningstid	1,14	0,74	1,68
Återstående kapitalbindningstid (exkl löften)	2,29	1,87	2,85
Andel räntejustering inom 12 mån	69%	80%	54%
Andel lån med förfall inom 12 mån (exkl löften)	29%	39%	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	373 mkr	OK
Likviditetsreserv (som lägst det högsta värdet av 300 mkr eller samlade låneförfall inom en 12-mån period)	2000 mkr	2975 mkr	OK
Genomsnittlig löptid utlåningsportföljen (i relation till löptid extern upplåning)	Max >1 år	-0,4 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

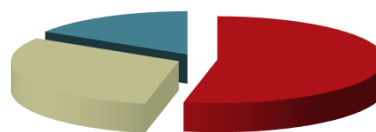


	Rambelopp (mkr)	2021-02-28
Ram för upplåning i Lunds kommuns namn	12 045	9 873
EVP	424	84
Certprogram	2 000	1 000
MTN-program	8 000	3 300

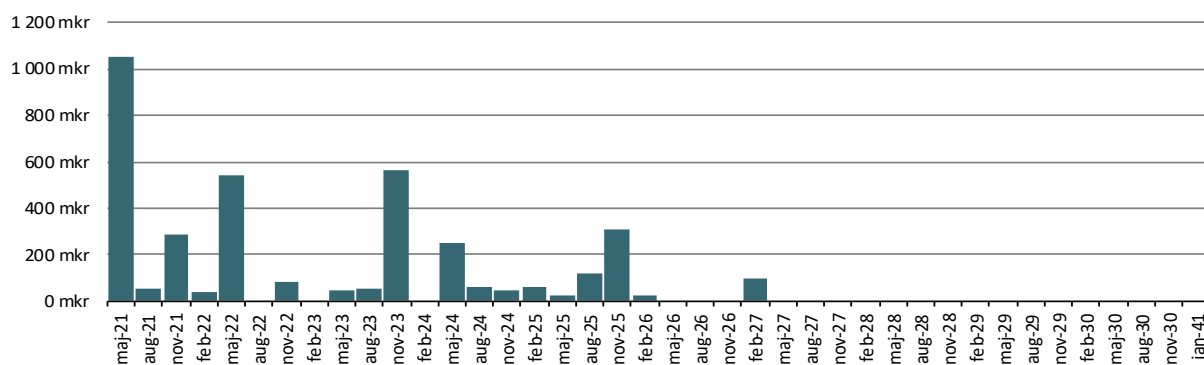
Diagramet visar förfalloprofil med hänsyn tagen till kreditlöften. Andelen korta förfall minskas därmed av outnyttjad löftesvolym förutsatt att löftena har en längre löptid än kapitalförfallet. Kapitalförfallen får då kreditlöfternas förfalldatum.

2b. EXTERN UPPLÅNING - UPPLÅNINGSFORMER

Upplåningsform	Akt. skuld (tkr)	Antal pos	% av skuld
MTN	3 300 000	7	53%
KI	1 900 000	5	31%
CERT	1 000 000	6	16%
Check	0	1	0%
Summa	6 200 000	19	100%



■ MTN ■ KI ■ CERT ■ Check

3a. UTLÅNING - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDNING & BESLUTAD RAM

Utlånings- och borgensramar

	Rambelopp (mkr)	2021-02-28
<i>Majoritetsägda bolag</i>		
LKF	7 000	5 350
LK Parkerings AB	400	270
Kraftringen	-	-
<i>Minoritetsägda bolag och kommunalförbund</i>		
VA Syd	1 000	898
Sydvatten	393	265
SVS	55	11

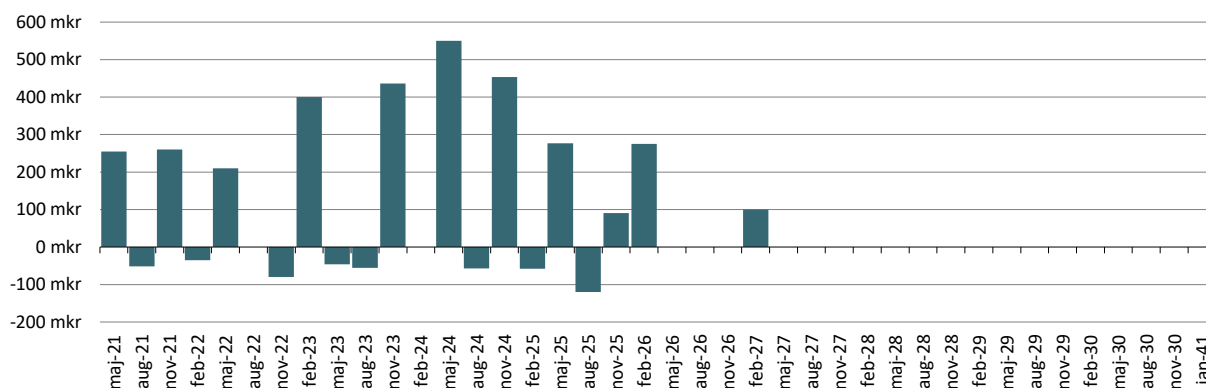
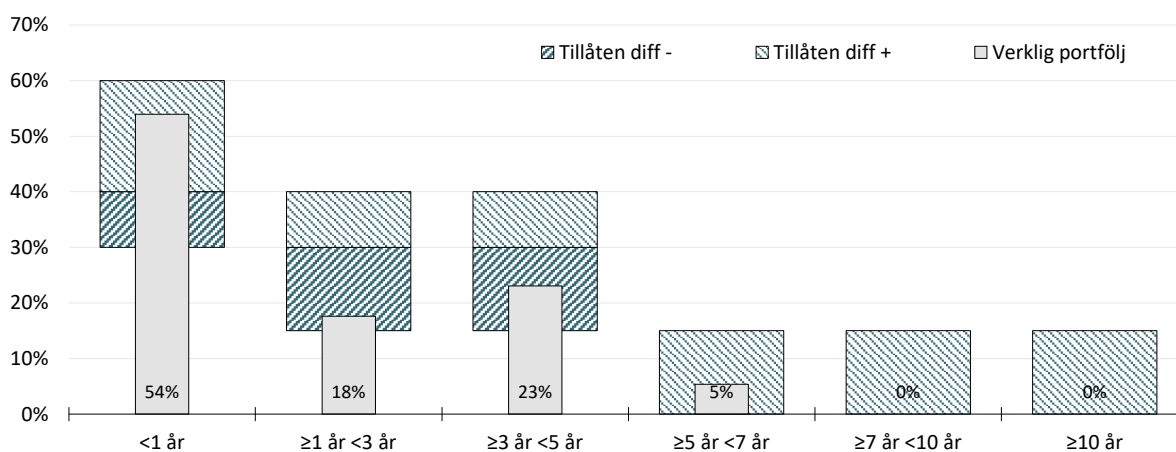
Koncernkontolimit

	Rambelopp (mkr)	2021-02-28
LKF	275	
LK Parkerings AB	110	70
Kraftringen AB	120	50

3b. UTLÅNING - LÅN PER LÅNTAGARE

Låntagare	Utlåning tkr	Kontosaldo tkr	Totalt tkr	%
LKF	2 250 000		2 250 000	61%
VA Syd	897 633		897 633	24%
Nordea		373 448	373 448	10%
LK Parkerings AB	69 527		69 527	2%
Kraftringen AB	49 560		49 560	1%
Fast. AB Lund Arena	30 000		30 000	1%
Kommuninvest			0	0%
Div föreningar	10 348		10 348	0%
Övriga banker		7 842	7 842	0%
AF Borgen AB	6 000		6 000	0%
SVS AB	10 500		10 500	0%
Summa	3 323 568	381 290	3 704 858	100%


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

4a. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL KAPITALBINDING

4b. NETTOPORTFÖLJ - FÖRFALLOPROFIL RÄNTEBINDNING

4c. NETTOPORTFÖLJ - MARKNADSVÄRDE DERIVAT PER MOTPART (mkr)

Motpart	Volym	Värde	Gräns	Antal pos	% av exp	Snittvolym
Swedbank	200	-0,4	-200	1	9%	200
SHB	425	0,4	-200	3	19%	142
SEB	150	1,3	-200	1	7%	150
Nordea	150	-0,9	-200	1	7%	150
Danske	1350	4,2	-200	10	59%	135
Summa	2 275	4,6		16	100%	142

4d. NETTOPORTFÖLJ - RÄNTEKOSTNADSPROGNOS

	2021	2022	2023	2024	2025
Bas	17,8	25,4	33,3	41,8	49,0
Hög	25,1	41,2	61,1	82,9	101,0
Låg	11,7	11,6	9,1	6,1	2,4
varav löftesprovision	3,7	3,7	3,7	3,7	3,7

Utgående nettoskuldvolym	2 719	3 180	3 523	3 892	4 192	4 192
---------------------------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------	--------------

5. PLACERINGAR - PENSIONSPORFÖLJEN

Tillgångslag	Anskaffnings- värde	Marknadsvärde 2020-12-31	Marknadsvärde 2021-02-28	%förändring från årskiftet	Fördeln %	Placeringslimiter	
						Lägst %	Högst %
Räntebärande placeringar							
Återlån till Lunds kommun		558 229 902	558 229 902	0,0%			
Avräkningsskuld till Lunds kommun		-203 413 155	-203 413 155	0,0%			
Summa räntebärande placeringar		354 816 747	354 816 747	0,0%	58	40	60
Aktierelaterade placeringar							
<u>Svenska aktiefonder</u>							
Robur Transition Sweden Mega	32 514 577	35 465 280	35 572 537	0,3%			
Öhman Sverige Hållbar B	40 684 102	44 558 479	46 744 399	4,9%			
SPP Sverige Plus B	25 346 204	29 411 308	30 522 140	3,8%			
Delsumma svenska fonder	98 544 883	109 435 067	112 839 075	3,1%	18		
<u>Globala aktiefonder</u>							
Robur Transition Global	24 854 694	40 191 096	40 893 412	1,7%			
Robur Global Impact	10 027 844	10 688 873	10 723 964	0,3%			
SHB Global Dynamisk 90 (A9)	31 990 946	38 949 109	40 267 330	3,4%			
SPP Global Plus A	10 064 621	18 375 906	19 035 346	3,6%			
Öhman Global Hållbar A	10 454 582	18 079 068	18 551 782	2,6%			
Delsumma globala fonder	87 392 687	126 284 052	129 471 834	2,5%	21		
<u>Strukturerade produkter</u>							
Garantum Global Hållbarhet	4 280 000	3 934 400,00	3 978 000	1,1%			
Consensus Autocall	3 400 000	2 996 760,00	3 144 660	4,9%			
Delsumma strukturerade prod	7 680 000	6 931 160	7 122 660	2,8%	1	0	25
Summa aktierelaterade placeringar	193 617 570	242 650 279	249 433 569	2,8%	41	30	50
Likvida medel							
Depåkonto Garantum		8 055 000	8 055 000				
Depåkonto Handelsbanken		1 099 587	1 099 587				
Delsumma		9 154 587	9 154 587	0,0%	1	0	10
Summa Pensionsmedel		606 621 613	613 404 903	1,1%	100		

I marknadsvärde per 2021-02-28 för återlånet och för avräkningsskulden ingår kapital jämte upplupen ränta.