



BÄSTA LIVSPLATSEN

**Region Halland**

**TJÄNSTESKRIVELSE**

Datum  
2017-08-22

Diarienummer  
RS170175

Åke Bengtsson, finanschef  
Ekonomi o finans  
tfn 070-5588274  
ake.bengtsson@regionhalland.se

## **Regionstyrelsen**

### **Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2017-07-31**

Stockholmsbörsen var svag under sommaren och sjönk med ca 3 procent under juli, vilket var sämre än på andra börser i världen.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation minskade under juli med 14,4 MKR eller 2,2 procent till 636,2 MKR.

Svensk inflation steg under perioden men hamnar fortfarande under målet, men Riksbanken tog bort sannolikheten för ytterligare räntesänkningar.

Den svenska tioårsräntan steg från 0,66 procent till 0,74 procent och den svenska tvåårsräntan sjönk -0,63 procent till -0,67 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen sjönk med 0,9 MKR och värdet uppgick därefter till 955,70 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen sjönk med 15,0 MKR eller 0,9 procent till 1 591,9 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 20,8 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 5,8 MKR.

Budgetvärdet för hela 2017 uppgår till 35,0 MKR. I bilaga till rapporten framgår pensionsmedelsportföljens innehav i aktie-och räntefonder.

## **Regionkontoret**

Catarina Dahlöf  
Regiondirektör

William Hedman  
Ekonomidirektör

# PORTFÖLJRAPPOR, PENSIONSMEDEL SAMT AVKASTNING AV EGEN FÖRVALTNING

## SAMMANFATTNING

Juli 2017

### 1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
<b>Räntor och likvida medel</b>	<b>955,7</b>	<b>60,0 %</b>
Varav svenska	955,7	60,0%
<b>Aktier</b>	<b>636,2</b>	<b>40,0 %</b>
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	420,0	26,5
Globala	168,5	10,5
Miljö (andel av aktier)	47,1	3,0 (7,4)
<b>Totalt</b>	<b>1 591,9</b>	<b>100,0%</b>

### 2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2016-12-31	1 502,8 MKR
Marknadsvärde 2017-07-31	1 591,9 MKR
Värdeförändring juli 2017	-15,0 MKR
<b>Värdeförändring 2017</b>	<b>89,1 MKR = 6,0 %</b>
Bokförd avkastning 2017, pensionsmedel	20,8 MKR

### 3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2016-12-31	1 540,9 MKR
Verksamhetsmedel 2017-07-31	1 439,7 MKR
Bokförd avkastning 2017, verksamhetsmedel	5,8 MKR
<b>Budgeterad avkastning totalt 2017</b>	<b>35,0 MKR</b>
<b>Bokförd avkastning tom 2017-07-31</b>	<b>26,6 MKR</b>

## Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2017-07-31

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring		Juli		Innevarande år	
	2016-12-31	2017-07-31	2017-07-31	Mkr Juli	Andel % Juli	Portfölj	Index	Portfölj	Index
<b>Aktier</b>									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	236,4	250,9	15,8	-7,8	-0,3	-3,0	-3,0	6,1	6,2
Robur Ethica Sverige Mega	140,2	149,7	9,4	-5,1	-0,2	-3,3	-3,3	6,8	7,1
Robur Global Emerging Markets	20,7	24,5	1,5	0,6	0,1	2,4	1,6	17,9	11,7
Robur Ethica Global	32,7	34,9	2,2	-0,4	0,0	-1,1	-1,8	6,8	0,9
Handelsbanken Amerikafond	43,8	46,0	2,9	-1,1	0,0	-2,3	-2,1	5,0	1,3
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	32,3	33,1	2,1	-0,1	0,0	-0,3	-1,4	2,4	2,0
SPP Global Plus		30,0	1,9	0,3		-1,8	-1,8	-3,8	-4,5
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	25,0	27,2	1,7	-0,2	0,0	-0,9	-1,1	8,7	4,5
Öhman Sverige Hållbar	19,1	19,9	1,3	-0,6	0,0	-3,2	-3,0	4,2	7,5
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 ( kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	1,3		0,0				
<b>Räntebärande</b>									
Robur Realräntefond	16,8	16,8	1,1	0,1	0,0	0,1	0,0	-0,2	7,1
Robur Företagsobligationsfond FRN	84,3	84,8	5,3	0,0	0,1	0,0	-0,1	0,6	-0,4
Robur Räntefond Kort Plus	317,4	318,3	20,0	0,4	0,2	0,1	-0,1	0,3	-0,4
Robur Företagsobligationsfond	47,3	48,1	3,0	0,3	0,0	0,7	0,5	1,7	0,8
Handelsbanken Flexibel ränta	158,5	159,7	10,0	-0,5	0,1	-0,3	-0,4	0,7	4,6
Öhmans företagsobligationsfond	55,3	56,4	3,5	0,1	0,0	0,2	0,8	2,1	1,4
Öhman FRN fond	166,4	169,1	10,6	0,4	0,1	0,2	-0,1	1,6	-0,5
SEB Microlånefond	26,6	27,5	1,7	-1,2	-0,1				
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1	25,0	1,6	-0,2	0,0	-0,6	0,0	-0,2	0,0
SPP Grön Obligationsfond		50,0	3,1			0,1	0,0	0,5	-0,2
Nordea Institutionell kortrräntefond	34,9		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>TOTALT</b>									
<b>Aktier</b>	<b>570,2</b>	<b>636,2</b>	<b>40,0</b>	<b>-14,4</b>	<b>-0,6</b>	<b>-2,2%</b>		<b>11,6%</b>	
<b>Räntebärande</b>	<b>932,6</b>	<b>955,7</b>	<b>60,0</b>	<b>-0,6</b>	<b>0,5</b>	<b>-0,1%</b>		<b>2,5%</b>	
<b>SUMMA</b>	<b>1 502,8</b>	<b>1 591,9</b>	<b>100,0</b>	<b>-15,0</b>		<b>-0,9%</b>		<b>5,9%</b>	