



BÄSTA LIVSPLATSEN

Region Halland

TJÄNSTESKRIVELSE

Datum
2017-06-21

Diarienummer
RS160122

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2017-05-31

Börsen i Sverige fortsatte att stiga, i maj med 1,5 procent, i likhet med flera andra internationella börser.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation ökade under maj med 10,2 MKR eller 1,6 procent till 664,1 MKR.

Svensk inflation normaliserades under perioden men hamnar fortfarande under målet. Styrräntorna beräknas vara noll först i mitten av 2019. Den svenska tioårsräntan sjönk från 0,57 procent till 0,47 procent och den svenska tvåårsräntan sjönk -0,66 procent till -0,71 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen steg med 1,9 MKR och värdet uppgick därefter till 958,0 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg med 12,1 MKR eller 0,8 procent till 1 622,1 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 19,2 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 4,3 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

Maj 2017

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	958,0	59,1 %
Varav svenska	958,1	59,1%
Aktier	664,1	40,9 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	443,5	27,3
Globala	172,1	10,5
Miljö (andel av aktier)	48,5	3,0 (7,3)
Totalt	1 622,1	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2016-12-31	1 502,8 MKR
Marknadsvärde 2017-05-31	1 622,1 MKR
Värdeförändring maj 2017	12,1 MKR
Värdeförändring 2017	119,3 MKR = 7,9 %
Bokförd avkastning 2017, pensionsmedel	19,2 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2016-12-31	1 540,9 MKR
Verksamhetsmedel 2017-05-31	1 417,1 MKR
Bokförd avkastning 2017, verksamhetsmedel	4,3 MKR
Budgeterad avkastning totalt 2017	35,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2017-05-31	23,5 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2017-05-31

	MARKNADSVÄRDE				AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring	Maj		Innevarande år	
	2016-12-31	2017-05-31	2017-05-31	Mkr Maj	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier								
Handelsbanken Sverige Index Criteria	236,4	264,5	16,3	4,5	1,7	1,7	11,9	12,0
Robur Ethica Sverige Mega	140,2	159,0	9,8	3,5	2,2	1,5	13,4	13,2
Robur Global Emerging Markets	20,7	24,1	1,5	0,5	2,2	0,9	16,0	12,0
Robur Ethica Global	32,7	36,2	2,2	0,7	1,9	0,0	10,9	5,3
Handelsbanken Amerikafond	43,8	47,8	2,9	0,1	0,1	-0,5	9,0	5,6
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	32,3	34,0	2,1	0,3	0,8	0,1	5,2	6,0
SPP Global Plus		30,0	1,8	0,1	0,1	0,0	-0,1	-0,3
<i>Miljöfonder</i>								
Handelsbanken hållbar energi	25,0	27,4	1,7	0,4	1,4	0,9	9,4	7,1
Öhman Sverige Hållbar	19,1	21,1	1,3	0,1	0,5	1,7	10,8	13,0
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 (kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	1,2					
Räntebärande								
Robur Realräntefond	16,8	16,9	1,0	0,1	0,3	0,3	0,5	0,4
Robur Företagsobligationsfond FRN	84,3	84,8	5,2	0,1	0,1	-0,1	0,5	-0,3
Robur Räntefond Kort Plus	317,4	317,9	19,6	0,1	0,0	-0,1	0,1	-0,3
Robur Företagsobligationsfond	47,3	47,9	3,0	0,2	0,4	0,2	1,3	0,6
Handelsbanken Flexibel ränta	158,5	161,2	9,9	0,7	0,4	0,4	1,7	0,9
Öhmans företagsobligationsfond	55,3	56,5	3,5	0,3	0,5	0,4	2,2	1,2
Öhman FRN fond	166,4	168,6	10,4	0,3	0,2	-0,1	1,3	-0,4
SEB Microlånefond	26,6	28,7	1,8	0,0				
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1	25,2	1,6	-0,1	-0,3	0,0	0,5	0,0
SPP Grön Obligationsfond		50,3	3,1	0,2	0,3	0,2	0,6	0,3
Nordea Institutionell kortrräntefond	34,9		0,0	0,0				
TOTALT								
Aktier	570,2	664,1	40,9	10,2	1,6%		16,5%	
Räntebärande	932,6	958,0	59,1	1,9	0,2%		2,7%	
SUMMA	1 502,8	1 622,1	100,0	12,1	0,8%		7,9%	