



Datum
2017-10-19

RS170175

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2017-09-30

Stockholmsbörsen återhämtades kraftigt efter tre raka förlustmånader och uppgången blev +5,7 procent.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation ökade under september med 29,3 MKR eller 4,6 procent till 659,5 MKR.

Svensk inflation är runt målet på 2 procent men Riksbanken tror fortfarande på låga räntor under överskådlig tid.

Den svenska tioårsräntan steg från 0,80 procent till 0,92 procent och den svenska tvåårsräntan var oförändrad -0,68 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen ökade med 1,3 MKR och värdet uppgick därefter till 957,9 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg med 30,6 MKR eller 1,9 procent till 1 617,4 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 37,3 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 8,3 MKR.

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

Regionkontoret

William Hedman
Ekonomidirektör

Åke Bengtsson
Finanschef

PORTFÖLJRAPPOR, PENSIONSMEDEL SAMT AVKASTNING AV EGEN FÖRVALTNING

SAMMANFATTNING

September 2017

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	957,9	59,2 %
Varav svenska	957,9	59,2%
Aktier	659,5	40,8 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	437,5	27,0
Globala	172,1	10,7
Miljö (andel av aktier)	49,9	3,1 (7,5)
Totalt	1 617,4	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2016-12-31	1 502,8 MKR
Marknadsvärde 2017-09-30	1 617,4 MKR
Värdeförändring september 2017	30,6 MKR
Värdeförändring 2017	114,6 MKR = 8,0 %
Bokförd avkastning 2017, pensionsmedel	37,3 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2016-12-31	1 540,9 MKR
Verksamhetsmedel 2017-09-30	1 416,3 MKR
Bokförd avkastning 2017, verksamhetsmedel	8,3 MKR
Budgeterad avkastning totalt 2017	35,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2017-09-30	45,6 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2017-09-30

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring		September		Innevarande år	
	2016-12-31	2017-09-30	2017-09-30	September	September	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	236,4	262,0	16,2	12,8	0,5	5,1	5,0	10,8	10,8
Robur Ethica Sverige Mega	140,2	155,5	9,6	7,8	0,3	5,3	5,0	11,0	10,8
Robur Global Emerging Markets	20,7	25,2	1,6	0,4	0,0	1,8	1,2	21,7	18,8
Robur Ethica Global	32,7	35,6	2,2	1,1	0,0	3,2	4,0	9,1	8,5
Handelsbanken Amerikafond	43,8	47,9	3,0	2,0	0,1	4,4	4,3	9,3	4,5
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	32,3	33,6	2,1	1,0	0,0	3,2	4,5	4,0	5,3
SPP Global Plus		29,8	1,8	1,3	0,0	4,8	4,9	-0,7	-1,3
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	25,0	29,1	1,8	1,8	0,1	6,6	7,8	16,2	10,6
Öhman Sverige Hållbar	19,1	20,8	1,3	1,1	0,8	5,6	5,6	8,9	12,5
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 (kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	1,2		0,0				
Räntebärande									
Robur Realräntefond	16,8	16,9	1,0	0,0	0,0	0,2	0,1	0,6	0,8
Robur Företagsobligationsfond FRN *	84,3								
Robur Räntefond Kort Plus *	317,4	402,9	24,9	0,0	-0,5	0,1	0	2	-0,3
Robur Ethica Företagsobligationsfond	47,3	48,2	3,0	0,0	-0,1	0,0	-0,1	2,9	2,4
Handelsbanken Flexibel ränta	158,5	160,7	9,9	0,8	-0,1	0,5	0,3	1,4	0,2
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	55,3	56,6	3,5	0,0	-0,1	0,0	-0,2	2,3	1,8
Öhman FRN fond	166,4	169,7	10,5	0,3	-0,2	0,1	-0,1	2	-0,6
SEB Microlånefond	26,6	27,5	1,7	0,0	0,0				
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1	25,1	1,6	0,2	0,0	0,8	0,0	0,2	0,0
SPP Grön Obligationsfond		50,3	3,1	0,0	-0,1	0,1	-0,2	0,6	-0,2
Nordea Institutionell kortrräntefond	34,9								
* Företagsobligationfon FRN har fusionerats till Räntefond kort plus									
TOTALT									
Aktier	570,2	659,5	40,8	29,3	1,1	5%		16%	
Räntebärande	932,6	957,9	59,2	1,3	-1,1	0%		3%	
SUMMA	1 502,8	1 617,4	100,0	30,6		2%		8%	