



BÄSTA LIVSPLATSEN

Region Halland

TJÄNSTESKRIVELSE

Datum
2017-11-14

Diarienummer
RS170175

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2017-10-31

Världens börser fortsatte uppåt även under oktober månad och stockholmsbörsen steg med +2,5 procent.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation ökade under oktober med 18,9 MKR eller 2,9 procent till 678,4 MKR.

Inflationen är fortfarande runt målet 2 procent men Riksbanken ser ingen anledning att ändra räntepolitik utan är beroende av de beslut ECB fattar.

Den svenska tioårsräntan sjönk från 0,92 procent till 0,79 procent och den svenska tvåårsräntan sjönk från -0,68 procent till -0,77 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen ökade med 1,1 MKR och värdet uppgick därefter till 959,0 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg med 20,0 MKR eller 1,2 procent till 1 637,4 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 46,6 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 8,6 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

Oktober 2017

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	959,0	58,6 %
Varav svenska	959,0	58,6%
Aktier	678,4	41,4 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	445,3	27,2
Globala	180,9	11,1
Miljö (andel av aktier)	52,2	3,1 (7,7)
Totalt	1 637,4	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2016-12-31	1 502,8 MKR
Marknadsvärde 2017-10-31	1 637,4 MKR
Värdeförändring oktober 2017	20,0 MKR
Värdeförändring 2017	134,6 MKR = 9,0 %
Bokförd avkastning 2017, pensionsmedel	46,6 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2016-12-31	1 540,9 MKR
Verksamhetsmedel 2017-10-31	1 695,1 MKR
Bokförd avkastning 2017, verksamhetsmedel	8,6 MKR
Budgeterad avkastning totalt 2017	35,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2017-10-31	55,2 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2017-10-31

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel % 2017-10-31	Förändring		Oktober		Innevarande år	
	2016-12-31	2017-10-31		Mkr	Andel % Oktober	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	236,4	266,3	16,3	4,3	0,1	1,6	1,7	12,6	12,7
Robur Ethica Sverige Mega	140,2	159,0	9,7	3,5	0,1	2,2	2,5	13,4	15,5
Robur Global Emerging Markets	20,7	26,6	1,6	1,4	0,1	5,4	6,2	28,2	21,9
Robur Ethica Global	32,7	37,7	2,3	2,1	0,1	5,8	4,5	15,4	8,9
Handelsbanken Amerikafond	43,8	50,0	3,1	2,1	0,1	4,4	5,3	14,1	10,1
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	32,3	35,4	2,2	1,8	0,1	5,4	4,7	9,7	10,3
SPP Global Plus		31,2	1,9	1,4	0,1	4,7	4,5	3,9	3,2
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	25,0	30,7	1,9	1,6	0,1	5,5	4,9	22,6	16,1
Öhman Sverige Hållbar	19,1	21,5	1,3	0,7	0,0	3,5	2,1	12,7	14,9
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	0,3	0,2	0,9	0,7
Robur Företagsobligationsfond FRN	84,3		0,0						
Robur Räntefond Kort Plus *	317,4	403,1	24,6	0,2	-0,3	0,0	-0,1	0,3	-0,7
Robur Ethica Företagsobligationsfond	47,3	48,5	3,0	0,3	0,0	0,5	0,5	0,4	0,4
Handelsbanken Flexibel ränta	158,5	161,4	9,9	0,7	-0,1	0,5	0,4	1,8	0,6
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	55,3	56,7	3,5	0,1	0,0	0,1	1,1	2,5	2,9
Öhman Grön Obligation	166,4	169,7	10,4	0,0	-0,1	0,1	0,0	0,1	0,0
SEB Microlånefond	26,6	27,0	1,6	-0,5	-0,1				
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1	25,2	1,5	0,1	0,0	0,3	0,0	0,5	0,0
SPP Grön Obligationsfond		50,5	3,1	0,2	0,0	0,3	0,3	0,9	0,1
Nordea Institutionell kortrräntefond	34,9		0,0						
TOTALT									
Aktier	570,2	678,4	41,4	18,9	0,7	3%		19%	
Räntebärande	932,6	959,0	58,6	1,1	-0,7	0%		3%	
SUMMA	1 502,8	1 637,4	100,0	20,0		1%		9%	