



Datum
2018-05-17

Diarienummer
RS180098

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2018-04-30

Stockholmsbörsen steg med 4,1 procent under april. Globalindex som utgörs av de flesta större marknader, steg med 2,0 procent.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation steg under april med 30,4 MKR eller 4,1 procent till 765,6 MKR.

Riksbanken fortsätter att tveka inför en kommande räntehöjning. Trots en försvagad valuta är den underliggande inflationen fortfarande något under målet 2 procent.

Under april sjönk den svenska tioårsräntan från 0,68 procent till 0,73 procent medan den svenska tvåårsräntan sjönk från -0,58 procent till -0,62 procent. Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen ökade i april med 3,6 MKR till 910,7 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg i april med 34,0 MKR eller 2,1 procent till 1 676,3 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 17,8 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 2,8 MKR. Total avkastning för pensionsmedel och verksamhetsmedel uppgick till 20,6 MKR (räntor, reavinster, utdelningar).

Budgetvärdet för hela 2018 uppgår till 30,0 MKR. I bilaga till rapporten framgår pensionsmedelsportföljens innehav i aktie-och räntefonder.

Regionkontoret

Stefan Sorpola
Ekonomidirektör

Åke Bengtsson
Finanschef

PORTFÖLJRAPPOR, PENSIONSMEDEL SAMT AVKASTNING AV EGEN FÖRVALTNING

SAMMANFATTNING

April 2018

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	910,7	54,3 %
Varav svenska	910,7	54,3%
Aktier	765,6	45,7 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	438,7	26,2
Globala	272,4	16,3
Miljö (andel av aktier)	54,5	3,2 (7,1)
Totalt	1 676,3	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2017-12-31	1 650,2 MKR
Marknadsvärde 2018-04-30	1 676,3 MKR
Värdeförändring april 2018	34,0 MKR
Värdeförändring 2018	26,1 MKR = 1,6 %
Bokförd avkastning 2018, pensionsmedel	17,8 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2017-12-31	1 789,5 MKR
Verksamhetsmedel 2018-04-30	1 751,9 MKR
Bokförd avkastning 2018, verksamhetsmedel	2,8 MKR
Budgeterad avkastning totalt 2018	30,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2018-04-30	20,6 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2018-04-30

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring		April		Innevarande år	
	2017-12-31	2018-04-30	2018-04-30	Mkr April	Andel % April	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	254,3	263,4	15,7	10,5	0,3	4,2	4,2	3,6	3,7
Robur Ethica Sverige Mega	153,9	155,3	9,3	4,5	0,1	3,0	4,1	0,9	4,4
Robur Global Emerging Markets	27,3	28,4	1,7	0,5	0,0	1,8	4,1	4,1	7,8
Robur Ethica Global	37,5	40,3	2,4	2,2	0,1	5,7	5,7	7,6	6,6
Handelsbanken Amerikafond	50,3	54,5	3,3	2,2	0,1	4,1	4,5	8,3	7,1
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	35,8	38,9	2,3	1,9	0,1	5,0	5,4	8,5	6,8
Handelsbanken Global Smab Ind	30,3	32,5	1,9	1,5	0,1	4,8	4,8	7,3	7,4
Handelsbanken Läkemedelsfond	15,0	44,5	2,7	2,4	0,1	5,8	5,4	9,8	6,5
SPP Global Plus	31,6	33,3	2,0	1,6	0,1	4,9	5,6	5,2	6,6
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	30,6	32,4	1,9	1,9	0,1	6,2	5,2	6,4	3,9
Öhman Sverige Hållbar	20,8	22,1	1,3	1,2	0,0	5,3	4,4	6,4	3,9
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 (kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	1,2		0,0				
Räntebärande									
Robur Realräntefond	16,9	16,9	1,0	0,0	0,0	0,5	0,5	0,3	0,2
Robur Räntefond Kort Plus	372,5	372,6	22,2	0,4	-0,4	0,1	-0,1	0,0	-0,3
Robur Ethica Företagsobligationsfond	48,3	48,3	2,9	0,1	-0,1	0,2	0,1	0,0	0,0
Handelsbanken Flexibel ränta	161,7	165,9	9,9	1,1	-0,1	0,7	0,4	2,6	2,0
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	56,6	57,1	3,4	0,2	-0,1	0,2	0,0	0,8	0,5
Öhman Grön Obligation	169,3	170,2	10,2	0,4	-0,2	0,2		0,5	
SEB Microlånefond	27,0	29,1	1,7	1,4	0,0	5,0		7,8	
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1	0,0							
SPP Grön Obligationfond	50,4	50,6	3,0	0,0	-0,1	0,1	0,2	0,4	0,6
Nordea Institutionell korträntefond	15,0	0,0							
TOTALT									
Aktier	707,4	765,6	45,7	30,4	0,9	4,1%		8,2%	
Räntebärande	942,8	910,7	54,3	3,6	-0,9	0,4%		-3,4%	
SUMMA	1 650,2	1 676,3	100,0	34,0		2,1%		1,6%	