

Datum
2018-07-17Diarienummer
RS180098

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2018-06-30

Under juni steg stockholmsbörsen med 0,4 procent vilket var i linje med de globala aktiemarknaderna.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation steg under juni med 1,9 MKR eller 0,3 procent till 742,8 MKR.

Riksbanken behåller räntan oförändrad men indikerar höjning mot slutet av året. Den underliggande svenska inflationen ligger fortfarande något över målet 2 procent.

Under juni sjönk den svenska tioårsräntan från 0,49 procent till 0,48 procent medan den svenska tvåårsräntan steg från -0,64 procent till -0,61 procent. Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen minskade i juni med -0,9 MKR till 939,1 MKR .

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg i juni med 1,0 MKR eller 0,1 procent till 1 681,9 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 24,2 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 4,6 MKR. Total avkastning för pensionsmedel och verksamhetsmedel uppgick till 28,8 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

Jörgen Preuss
Regiondirektör

Stefan Sorpola
Ekonomidirektör

PORTFÖLJRAPPOR, PENSIONSMEDEL SAMT AVKASTNING AV EGEN FÖRVALTNING

SAMMANFATTNING

Juni 2018

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	939,1	55,8 %
Varav svenska	939,1	55,8%
Aktier	742,8	44,2 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	408,0	24,4
Globala	280,9	16,7
Miljö (andel av aktier)	53,9	3,1 (7,2)
Totalt	1 681,9	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2017-12-31	1 650,2 MKR
Marknadsvärde 2018-06-30	1 681,9 MKR
Värdeförändring juni 2018	1,0 MKR
Värdeförändring 2018	41,7 MKR = 1,9 %
Bokförd avkastning 2018, pensionsmedel	24,2 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2017-12-31	1 789,5 MKR
Verksamhetsmedel 2018-06-30	1 916,6 MKR
Bokförd avkastning 2018, verksamhetsmedel	4,6 MKR

Budgeterad avkastning totalt 2018	30,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2018-06-30	28,8 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2018-06-30

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring		Juni		Innevarande år	
	2017-12-31	2018-06-30	2018-06-30	Mkr Juni	Andel % Juni	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	254,3	234,1	13,9	0,9	0,0	0,4	0,2	3,6	3,6
Robur Ethica Sverige Mega	153,9	153,9	9,2	-1,2	-0,1	-1,0	0,4	-0,3	4,4
Robur Global Emerging Markets	27,3	26,4	1,6	-1,2	-0,1	-4,4	-2,9	-3,1	2
Robur Ethica Global	37,5	41,4	2,5	0,7	0,0	2,0	1,2	10,7	9,7
Handelsbanken Amerikafond	50,3	57,4	3,4	0,8	0,0	1,4	2,0	14,0	13,2
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	35,8	40,8	2,4	1,1	0,1	2,7	0,8	13,9	13,2
Handelsbanken Global Smab Ind	30,3	34,0	2,0	0,3	0,0	1,1	1,1	12,3	12,4
Handelsbanken Läkemedelsfond	15,0	46,8	2,8	1,0	0,1	2,1	2,6	15,5	10,9
SPP Global Plus	31,6	34,1	2,0	0,4	0,0	1,3	1,3	7,9	9,7
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	30,6	32,2	1,9	-0,9	-0,1	-2,8	-6,4	5,3	-1,2
Öhman Sverige Hållbar	20,8	21,7	1,3	0,0	0,0	0,0	0,3	4,5	4,1
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 (kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	1,2	0,0	0,0				
Räntebärande									
Robur Realräntefond	16,9	17,2	1,0	0,1	0,0	0,4	0,5	1,2	1,2
Robur Räntefond Kort Plus	372,5	371,4	22,1	-0,4	0,0	-0,1	-0,1	-0,3	-0,4
Robur Ethica Företagsobligationsfond	48,3	48,0	2,9	-0,1	0,0	-0,2	-0,1	-0,6	-0,2
Handelsbanken Flexibel ränta	161,7	165,1	9,8	-0,6	0,0	0,0	0,1	2,1	2
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	56,6	57,1	3,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,9	0,7
Öhman Grön Obligation	169,3	170,4	10,1	0,0	0,0	0,0		0,6	
SEB Microlånefond	27,0	29,2	1,7	0,1	0,0	0,0		8,1	
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1								
SPP Grön Obligation	50,4	50,7	3,0	0,1	0,0	0,1	0,1	0,5	0,9
SPP Global Företagsobligationsfond Plus		30,0	1,8	-0,1	0,0	-0,2	-0,2	0,1	0,3
Nordea Institutionell korträntefond	15,0								
TOTALT									
Aktier	707,4	742,8	44,2	1,9	0,1	0%		5%	
Räntebärande	942,8	939,1	55,8	-0,9	-0,1	0%		0%	
SUMMA	1 650,2	1 681,9	100,0	1,0		0%		1,92%	