



Datum
2018-09-18

Diarienummer
RS180098

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2018-08-31

Under augusti fortsatte stockholmsbörsen att gå upp och steg med 3,2 procent. På de stora börserna i världen var det en mer blandad bild.

Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation steg under augusti med 31,0 MKR eller 4,1 procent till 792,0 MKR.

Riksbanken behåller räntan oförändrad men indikerar en första höjning i slutet av året. Inflationen uppmättes för juli till 2,2 procent vilket är över Riksbankens mål på 2 procent.

Under augusti sjönk den svenska tioårsräntan från 0,63 procent till 0,55 procent medan den svenska tvåårsräntan sjönk från -0,54 procent till -0,56 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen ökade i augusti med 0,7 MKR till 941,2 MKR .

Marknadsvärdet för pensionsmedlen steg i augusti med 31,7 MKR eller 1,9 procent till 1 733,2 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 25,4 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 6,4 MKR. Total avkastning för pensionsmedel och verksamhetsmedel uppgick till 31,8 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
Tf regiondirektör

Stefan Sorpola
Ekonomidirektör

PORTFÖLJRAPPOR, PENSIONSMEDEL SAMT AVKASTNING AV EGEN FÖRVALTNING

SAMMANFATTNING

Augusti 2018

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	941,2	54,3 %
Varav svenska	941,2	54,3%
Aktier	792,0	45,7 %
Varav Svenska (inkl. aktieindexobl)	434,5	25,1
Globala	302,1	17,4
Miljö (andel av aktier)	55,4	3,2 (7,0)
Totalt	1 733,2	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2017-12-31	1 650,2 MKR
Marknadsvärde 2018-08-31	1 733,2 MKR
Värdeförändring augusti 2018	31,7 MKR
Värdeförändring 2018	83,0 MKR = 5,0 %
Bokförd avkastning 2018, pensionsmedel	25,4 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2017-12-31	1 789,5 MKR
Verksamhetsmedel 2018-08-31	1 897,2 MKR
Bokförd avkastning 2018, verksamhetsmedel	6,4 MKR

Budgeterad avkastning totalt 2018	30,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2018-08-31	31,8 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2018-08-31

	MARKNADSVÄRDE					AVKASTNING %			
	Mkr		Andel %	Förändring		Augusti		Innevarande år	
	2017-12-31	2018-08-31	2018-08-31	Mkr Juli	Andel % Augusti	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier									
Handelsbanken Sverige Index Criteria	254,3	249,4	14,4	6,1	0,1	2,5	2,6	10,4	10,5
Robur Ethica Sverige Mega	153,9	165,1	9,5	5,8	0,2	3,6	3,2	7,3	11,5
Robur Global Emerging Markets	27,3	25,9	1,5	0,0	0,0	0,1	1,2	-4,8	3,6
Robur Ethica Global	37,5	45,1	2,6	2,8	0,1	6,7	5,3	20,3	17
Handelsbanken Amerikafond	50,3	63,2	3,6	5,4	0,2	9,3	8,5	25,6	25,1
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	35,8	43,0	2,5	2,1	0,1	5,2	4,8	19,3	19,1
Handelsbanken Global Smab Ind	30,3	36,1	2,1	2,2	0,1	6,6	6,6	19,2	19,1
Handelsbanken Läkemedelsfond	15,0	52,2	3,0	3,5	0,1	7,2	7,1	28,8	23,8
SPP Global Plus	31,6	36,6	2,1	1,9	0,1	5,6	5,3	15,9	17,0
<i>Miljöfonder</i>									
Handelsbanken hållbar energi	30,6	32,9	1,9	0,6	0,0	2,1	3,6	7,7	2,6
Öhman Sverige Hållbar	20,8	22,5	1,3	0,6	0,0	2,2	2,6	7,9	11,2
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	0,2	0,2	1,3	1,3
Robur Räntefond Kort Plus	372,5	371,6	21,4	-0,2	-0,4	-0,1	-0,1	-0,3	-0,5
Robur Ethica Företagsobligationsfond	48,3	48,2	2,8	0,1	0,0	0,1	0,0	-0,3	0,0
Handelsbanken Flexibel ränta	161,7	164,7	9,5	0,2	-0,2	0,1	0,2	1,8	1,7
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	56,6	57,2	3,3	0,1	-0,1	0,2	0,2	1,0	0,8
Öhman Grön Obligation	169,3	170,7	9,8	0,3	-0,2	0,2		0,7	<i>Index saknas</i>
SEB Microlånefond	27,0	30,8	1,8	0,0	0,0	0,0		4,4	<i>Index saknas</i>
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1								
SPP Grön Obligation	50,4	50,7	2,9	0,0	-0,1	0,2	0,2	0,6	0,9
SPP Global Företagsobligationsfond Plus		30,1	1,7	0,1	0,0	0,1	0,2	0,2	0,6
Nordea Institutionell kortrräntefond	15,0								
TOTALT									
Aktier	707,4	792,0	45,7	31,0	1,0	4,1%		12,0%	
Räntebärande	942,8	941,2	54,3	0,7	-1,0	0,1%		-0,2%	
SUMMA	1 650,2	1 733,2	100,0	31,7		1,9%		5,0%	