



Datum
2019-01-28

Diarienummer
RS180098

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

Regionstyrelsen

Portföljrapport, pensionsmedel samt avkastning av egen förvaltning per 2018-12-31

Stockholmsbörsen avslutade året med en nedgång på -5,8 procent under december och på helår -4,6 procent och globalindex MSCI minskade -6,9 procent. Pensionsmedelsportföljens aktiedel, inkl. globala fonder, miljöfonder och aktieindexobligation minskade under december med -63,1 MKR eller -7,9 procent och uppgick till 737,8 MKR.

Riksbanken höjde reporäntan till -0,25 procent och inflationen ligger på 2,2 procent. Under december sjönk den svenska tioårsräntan till 0,56 procent medan den svenska tvåårsräntan steg till -0,39 procent.

Värdet på ränteplaceringarna i pensionsmedelsportföljen sjönk i december med -1,4 MKR och uppgick de till 860,6 MKR.

Marknadsvärdet för pensionsmedlen sjönk i december med -64,5 MKR eller -4,0 procent till 1 598,4 MKR. För helåret minskade värdet med -51,8 MKR. Den bokförda nettoavkastningen för pensionsmedel uppgår till 76,6 MKR. Bokförd avkastning för den egna ränteförvaltningen av verksamhetsmedel uppgick till 8,6 MKR. Total avkastning för pensionsmedel och verksamhetsmedel uppgick till 85,2 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

December 2018

1. Tillgångsfördelning, pensionsmedel

TILLGÅNGSSLAG	MARKNADSVÄRDE (MKR)	FÖRDELNING (%)
Räntor och likvida medel	860,6	53,8 %
Varav svenska	860,6	53,8%
Aktier	737,8	46,2 %
Varav Svenska (inkl. aktieidexobl)	372,6	23,3
Globala	270,7	17,0
Miljö (andel av aktier)	94,5	5,9 (12,8)
Totalt	1 598,4	100,0%

2. Utveckling, pensionsmedel

Marknadsvärde 2017-12-31	1 650,2 MKR
Marknadsvärde 2018-12-31	1 598,4 MKR
Värdeförändring december 2018	-64,5 MKR
Värdeförändring 2018	-51,8 MKR = -3,1%
Bokförd avkastning 2018, pensionsmedel	76,6 MKR

3. Utveckling verksamhetsmedel

Verksamhetsmedel 2017-12-31	1 789,5 MKR
Verksamhetsmedel 2018-12-31	2 009,4 MKR
Bokförd avkastning 2018, verksamhetsmedel	8,6 MKR

Budgeterad avkastning totalt 2018	30,0 MKR
Bokförd avkastning tom 2018-12-31	85,2 MKR

Rapport - förvaltning av pensionsmedel per 2018-12-31

	MARKNADSVÄRDE						AVKASTNING %			
	Mkr		Förändring	Förändring		December		Innevarande år		
	2017-12-31	2018-12-31	2018	Andel %	Mkr	Andel %	Portfölj	Index	Portfölj	Index
Aktier										
Handelsbanken Sverige Selektiv	254,3	210,4	-43,9	13,2	-13,6	-0,3	-6,1	-6,0	-15,9	-13,7
Robur Ethica Sverige Mega	153,9	142,2	-11,7	8,9	-9,3	-0,2	-6,1	-6,0	-7,6	-4,6
Robur Global Emerging Markets	27,3	22,2	-5,1	1,4	-1,4	0,0	-5,7	-4,2	-18,5	-6,6
Robur Ethica Global	37,5	39,3	1,8	2,5	-3,5	-0,1	-8,3	-9,4	4,8	-0,5
Handelsbanken Amerikafond	50,3	51,2	0,9	3,2	-7,3	-0,3	-12,5	-11,3	1,7	5,3
Handelsbanken Global Selektiv Criteria	35,8	37,8	2,0	2,4	-3,5	-0,1	-7,2	-7,8	5,5	-1,8
HandelsbankenGlobal Smab Ind	30,3	28,7	-1,6	1,8	-3,7	-0,2	-11,4	-11,5	-5,4	-5,5
Handelsbanken Hälsovård Tema	15,0	46,2	31,2	2,9	-5,0	-0,2	-9,9	-10,4	13,9	11,0
SPP Global Plus	31,6	31,0	-0,6	1,9	-3,5	-0,1	-10,1	-10,0	-1,9	-1,2
Öhman Global Hållbar		14,3	14,3	0,9	-2,2	-0,1	-8,8	-9,4	-13,3	-13,9
<i>Miljöfonder</i>										
Handelsbanken hållbar energi	30,6	26,3	-4,3	1,6	-3,3	-0,1	-11,1	-11,1	-14,1	-12,4
Öhman Sverige Hållbar	20,8	68,2	47,4	4,3	-6,8	-0,2	-7,0	-6,0	-8,6	-4,4
Aktieindexobligation OMX GS 20190520 (kap.gar. 100% - dg 115%)	20,0	20,0	0,0	1,3		0,0				
Räntebärande										
Robur Realräntefond	16,9	17,1	0,2	1,1	0,1	0,0	-0,2	-0,2	0,6	0,4
Robur Räntefond Kort Plus	372,5	369,6	-2,9	23,1	-0,1	0,9	0,0	-0,1	-0,8	-0,8
Robur Ethica Företagsobligationsfond	48,3	47,8	-0,5	3,0	0,0	0,1	-0,1	0,1	-1,1	-0,5
Handelsbanken Flexibel ränta	161,7	163,5	1,8	10,2	-1,0	0,3	-0,6	-0,4	1,2	0,6
Öhmans Företagsobligationsfond Hållbar	56,6	39,4	-17,2	2,5	0,0	0,1	-0,2	-0,3	0,4	-0,1
Öhman Grön Obligation	169,3	75,4	-93,9	4,7	-0,2	0,2	-0,2		0,5	
Öhman FRN Hållbar		37,2	37,2	2,3	-0,3	0,1	-0,2	-0,2	-0,8	-0,7
SEB Microlånefond	27,0	30,4	3,4	1,9	0,0	0,1	0,0		12,6	
Handelsbanken Räntestrategi Plus Criteria	25,1		-25,1	0,0	0,0	0,0				
SPP Grön Obligation	50,4	50,5	0,1	3,2	0,0	0,1	-0,1	0,5	-0,4	0,2
SPP Global Företagsobligationsfond Plus		29,7	29,7	1,9	0,1	0,1	0,5	0,5	-0,8	-0,4
Nordea Institutionell korträntefond	15,0		-15,0	0,0	0,0	0,0				
TOTALT										
Aktier	707,4	737,8	30,4	46,2	-63,1	-2,0	-8%			
Räntebärande	942,8	860,6	-82,2	53,8	-1,4	2,0	0%			
SUMMA	1 650,2	1 598,4	-51,8	100,0	-64,5		-4%		-3,1	

Index saknas

Index saknas