

Ekonomi- och personalavdelningen
Helena Edström
Tfn: 063-147712
E-post: helena.edstrom@regionjh.se

2022-07-22

RS/17/2022

Köp och försäljning av värdepapper i S&P depå

Ärendebeskrivning

Syftet med de föreslagna transaktionerna är att sänka risken i portföljen genom att minska andelen aktier och öka andelen ränteplaceringar. Detta då den senaste tidens turbulens på de finansiella marknaderna har fått portföljen att minska i värde, vilket i sin tur har gjort att marginalen till skyddsniån minskat. Vidare syftar transaktionerna till att placera 1,354 miljoner kronor av den befintliga likviditeten på S&P-depån.

Enligt policyn ska den riskkontrollerande strategin skydda 80% av portföljens högsta värde de senaste 24 månaderna. I dagsläget är marginalen ned till säkerhetsgolvet 11,0%, vilket innebär en sämre risksituation än vid månadsskiftet då marginalen uppgick 14,5%. Beräknad max-andel aktier uppgår för närvarande till 41%, medan den aktuella aktieandelen i portföljen är 44,8%. Då den aktuella andelen aktier överstiger den beräknade max-andelen aktier minskas andelen aktier med 8,0%-enheter med transaktionerna nedan. Detta för att sänka andelen aktier och därmed minska marginalen till den beräknade max-andelen aktier. Detta görs proportionerligt, sett till den regionala exponeringen i aktieportföljen. Då syftet med transaktionerna är att sänka risken i portföljen placeras försäljningslikviden primärt i korträntefonder, vilket är den räntefondskategori som har lägst risk. Vidare placeras även en mindre del i en obligationsfond med hög kreditvärdighet och lång duration. Detta för att inte durationen ska minska i ränteportföljen.

SEB Korträntefond SEK	73 906 554 kr
Storebrand Lång Obligation	10 665 683 kr
Carnegie Strategifond G	-802 918,96 kr
Cliens Småbolag	-3 599 570 kr
Spiltan Aktiefond Stabil	-3 814 140 kr
Storebrand Sverige Plus	-13 838 610 kr
Öhman Sweden Micro Cap	-201 737 kr
C WorldWide Global Equities Ethical	-5 997 562 kr
Handelsbanken Amerika Småbolag	-1 871 998 kr
Storebrand Emerging Markets Plus	-6 638 489 kr
Storebrand Global Plus	-26 953 562 kr
Storebrand USA	-10 513 516 kr
Swedbank Robur Transition Global J SEK	-5 732 761 kr
Öhman Global A	-4 607 367 kr
Storebrand Lång Obligationfond	1 354 000 kr

Beslutsunderlag

RS/16/2021 Skuld och tillgångsrapporter 2021, RS/17/2022 Skuld och tillgångsrapporter 2022 och Reglemente för finansverksamheten.

Delegationsbestämmelse och delegation

Regionstyrelsens delegationsbestämmelser med regiondirektörens vidaredelegering punkt 4.1.4 Upplåning, placering och förvaltning av likvida medel samt stiftelser/donationsfonder enligt Reglemente för finansverksamheten(Rs/783/2016)

Beslut

Fondandelarna ovan köps och säljs till bästa möjliga kurs.

Anders Byström
Tf Regiondirektör

Anmälan

Beslutet anmäls till regionstyrelsen.

Utdrag till

Ekonomidirektör
Finansekonom