

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

2023-04-06

RS/17/2023

Köp och försäljning av värdepapper

Ärendebeskrivning

Syftet med transaktionerna nedan är att öka aktieandelen i portföljen då risksituationen alltfjämt är mycket god. Vidare ämnar transaktionerna till att placera portföljens befintliga likvid om 453 906 sek.

Enligt reglementet ska den riskkontrollerande strategin skydda 80% av portföljens högsta värde de senaste 24 månaderna. I dagsläget är marginalen ned till säkerhetsgolvet 14,5%, vilket innebär en god riskmarginal. Beräknad max-andel aktier uppgår för närvarande till 55%, medan den aktuella aktieandelen i portföljen är 41,7%. Då den beräknade max-andelen aktier med god marginal överstiger den aktuella andelen syftar transaktionerna nedan att öka andelen aktier i portföljen med 5%-enheter till 46,7%. Detta för att utnyttja riskutrymmet och höja den förväntade avkastningen genom att ha en högre andel aktier i portföljen. Förslagsvis görs uppviktningen proportionerligt sett till den regionala exponeringen i aktieportföljen. Uppviktningen av aktier finansieras genom försäljningar i korträntefonder. Detta då korträntefonder är den räntefondskategori som har lägst risk och således lägst förväntad avkastning och syftet är att öka risken i portföljen. De föreslagna transaktionerna innebär att durationen i ränteportföljen ökar från 1,00 år till 1,06 år.

Cliens Småbolag	2 700 714 kr
Spiltan Aktiefond Stabil	2 800 740 kr
Storebrand Sverige Plus	10 102 671 kr
Öhman Sweden Micro Cap	100 026 kr
Barrow Hanley Global ESG Value Equity USD A	4 001 058 kr
C WorldWide Global Equities Ethical	4 101 084 kr
Handelsbanken Amerika Småbolag Tema SEK	1 800 476 kr
Storebrand Emerging Markets Plus	4 501 190 kr
Storebrand Global Plus	453 906 kr
	18 804 971 kr
Storebrand USA	9 402 485 kr
Swedbank Robur Transition Global J SEK	4 001 057 kr
Handelsbanken Korträntefond SEK	-8 300 000 kr
SEB Korträntefond SEK	-20 402 601 kr
Simplicity Likviditet	-22 211 624 kr
Swedbank Robur Räntefond Kort A	-11 402 251 kr

Beslutsunderlag

RS/16/2023 Skuld och tillgångsrapporter 2021, RS/17/2023 Skuld och tillgångsrapporter 2022 och Reglemente för finansverksamheten

Delegationsbestämmelse och delegation

Regionstyrelsens delegationsbestämmelser med regiondirektörens vidaredelegering punkt 4.1.5 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