

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

2024-02-12

RS/17/2024

Köp och försäljning av värdepapper

Ärendebeskrivning

Syftet med transaktionerna nedan är att öka risken i portföljen genom att öka andelen aktiefonder och minska andelen räntefonder. Detta för att utnyttja den goda risksituationen och höja den förväntade avkastningen i portföljen. Vidare syftar transaktionerna även till att öka den regionala diversifieringen i ränteportföljen.

Enligt reglementet ska den riskkontrollerande strategin skydda 80% av portföljens högsta värde de senaste 24 månaderna. I dagsläget är marginalen ned till säkerhetsgolvet 20,0%, vilket innebär en full riskmarginal och en mycket god risksituation i portföljen. Beräknad max-andel aktier uppgår för närvarande till 76%, medan den aktuella aktieandelen i portföljen är 63,8%. Då den beräknade max-andelen aktier med god marginal överstiger den aktuella kommer transaktionerna nedan att öka andelen aktier i portföljen med 4,5%-enheter till 68,3%. Detta för att utnyttja riskutrymmet och höja den förväntade avkastningen genom att ha en högre andel aktier i portföljen.

Uppviktningen kommer göra så att andelen utländska aktier ökar från 74,4% av aktieportföljen till 75,0%, vilket är i linje med normalportföljen i policyn, uppviktningen av aktier finansieras genom en försäljning i flera korträntefonder och en FRN-fond. Detta för att öka ränterisken i portföljen något utan att kreditrisken ökar för mycket.

Transaktionerna innebär att durationen i ränteportföljen ökar från 1,14 år till 1,25 år.

Cliens Småbolag A	1 700 740 kr
Lannebo Sverige	1 900 827 kr
Storebrand Sverige Plus A SEK	6 102 656 kr
Barrow Hanley Global ESG Value Eq A USD Acc	4 201 828 kr
C WorldWide Global Equities Ethical 1C Acc	4 602 003 kr
Handelsbanken Amerika Småbolag Tema	1 900 827 kr
Storebrand Emerging Markets Plus A SEK	4 602 003 kr
Storebrand Global Plus A SEK	20 809 057 kr
Storebrand USA A SEK	10 804 703 kr
Swedbank Robur Transition Global J	4 201 828 kr
Allianz Global Floating Rate Notes Plus WT	25 010 886 kr
SEB Korträntefond SEK	- 27 007 408 kr

Simplicity Likviditet	- 20 010 110 kr
Öhman FRN A	- 38 819 844 kr

Beslutsunderlag

RS/16/2024 Skuld och tillgångsrapporter 2024 och Reglemente för finansverksamheten
RS/783/2016

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.

Sara Lewerentz
Regiondirektör

Anmälan

Beslutet anmäls till regionstyrelsen

Utdrag till

Ekonomidirektör
Finansekonom