



Årsrapport extern medelförvaltning 2016

Ärendet

Kapitalet som är avsatt för att täcka delar av kommunens pensionsåtaganden är placerat i Cliens Mixfond Sverige B. Det är en aktivt förvaltd blandfond med etiskt placeringsreglemente. Fonden, med startdatum 31 december 2004, består av svenska räntebärande papper och svenska/nordiska aktier.

Sammantaget kan konstateras att avkastningen har varit positiv under 2016 samt att Cliens Mixfond har presterat över index.

Kommunledningskontorets förslag till beslut

Kommunstyrelsens beslut

Kommunstyrelsen beslutar att notera lämnad rapport till protokollet.

Bakgrund

I maj 1998 avsatte kommunen 300 miljoner kronor av intäkterna från försäljningen av Danderydsbostäder för extern långsiktig kapitalförvaltning. Syftet är att via kapitalet och avkastningen i första hand täcka kommunens åtaganden för pensioner intjänade före 1 januari 1998.

Kommunfullmäktige har beslutat om en placeringspolicy för långsiktig medelförvaltning, vilken reviderades senast enligt beslut i kommunfullmäktige 2013-09-23 § 66. Enligt placeringspolicyn ska kommunens förvaltningsmål uppnås genom att tillgångarna förvaltas på ett sådant sätt att dessa matchar delar av pensionsskulden. Riskspridningen ska vara god mellan de olika tillgångsslagen för att på så sätt säkerställa en bra diversifiering.

Kapitalet är placerat i Cliens Mixfond Sverige B som är en aktivt förvaltd blandfond med etiskt placeringsreglemente. Fonden, med startdatum 31 december 2004, består av svenska räntebärande papper och svenska/nordiska aktier. Exponeringen består av som minst 25 % aktier och som mest 75 % aktier vilket allokeras med fokus på att begränsa nedsiderisken. Fondens genomsnittliga årsavkastning 2016 uppgår till 10,5 % jämfört med index 6,8 %.

Kommunledningskontorets utredning/yttrande

Avkastningen 2016 blev 11,1 miljoner kronor eller 7,68 % mot ett index om 4,81 %. Ackumulerad avkastning från starten 3 juli 2014 resulterade i 37,7 miljoner kronor eller 25,41 % mot ett index om 12,47 %.



Ett uttag om 12,7 miljoner kronor skedde i slutet av året för att täcka delar av pensionsutbetalningarna enligt placeringsreglementet. Marknadsvärdet uppgick efter uttaget till 143,1 miljoner kronor per 31 december 2016. 19,5 mnkr har belastat kommunens driftsbudget för uttag till pensioner.

Vid utgången av december var fördelningen i Cliens Mixfond 65 % aktier och 31 % räntebärande. 4 % bestod av kassa och upplupen ränta. Bokfört värde uppgick till 117,9 miljoner kronor per 31 december 2016.

Sammantaget kan konstateras att avkastningen varit positiv under 2016 samt att Cliens Mixfond har presterat över index.

Åsa Heribertson
Kommundirektör

Cecilia von Sydow
Ekonomichef

Bilaga:

1. Cliens månadsrapport december 2016