

Rapport finansportefølje 30. juni 2024 – Sparebankstiftinga Sogn og Fjordane

Med unntak av bankinnskott er alle plasseringar i verdipapirfond. Sparebankstiftinga har to finansporteføljor;

Portefølje 1

Dette er beredskapsportefølje som har som formål å sikre eit stabilt og langsiktig eigarskap i Sparebanken Sogn og Fjordane. I tillegg skal porteføljen sikre gåvetildelingar og drift i Sparebankstiftinga i tre år.

Beredskapsportefølje per 30. juni 2024						
Aktivaklasse	Marknadsverdi (tall i mill. kr.)	Faktisk porteføljevekt	Målsatt porteføljevekt			Referanse indeks
			Strategi	Min.	Maks	
Pengemarknad	300,8	39,6 %	40 %	35 %	45 %	
Pengemarknad	150,4	19,8 %	20 %	15 %	25 %	NBP Norwegian Government Duration 3 M NOK
Bank	150,4	19,8 %	20 %	15 %	25 %	
Obligasjonar	303,4	39,9 %	40 %	25 %	35 %	
Norge	76,8	10,1 %	10 %	5 %	15 %	NBP Norwegian RM1-RM3 Duration 3 NOK
Global	226,6	29,8 %	30 %	25 %	35 %	Bloomberg Barclays Global Agg. Bond Index NOK
Aksjar	155,8	20,5 %	20 %	15 %	25 %	
Norge	55,1	7,3 %	7 %	2 %	12 %	Oslo Børs Totalindeks (OSEBX)
Global	100,7	13,3 %	13 %	8 %	18 %	MSCI AC World Indeks NR*
Sum aksjar og rente	760,0	100 %	100 %	100 %	100 %	

Portefølje 2

Denne portefølje er definert som portefølje med frie midlar og skal forvaltast i eit langsiktig perspektiv. Formålet med porteføljen er å bidra med kapital til å støtte allmennyttige formål for noverande og framtidige generasjonar i Sogn og Fiordane.

Portefølje med frie midlar						
Aktivaklasse	Marknadsverdi (tal i mill kr.)	Faktisk porteføljevekt	Målsatt porteføljevekt			Referanse indeks
			Strategi	Min	Maks	
Pengemarknad*	140,2	39,8 %	0 %	0 %	0 %	
Pengemarknad	0	0,0 %	0 %	0 %	0 %	NBP Norwegian Government Duration 3 M NOK
Bank*	140,2	39,8 %	0 %	0 %	0 %	
Obligasjonar	140,5	39,9 %	40 %	35 %	45 %	
Norge	35,3	10,0 %	10 %	5 %	15 %	NBP Norwegian RM1-RM3 Duration 3 NOK
Global	105,2	29,9 %	30 %	25 %	35 %	Bloomberg Barclays Global Agg. Bond Index NOK Hedged
Aksjar*	71,4	20,3 %	60 %	55 %	65 %	
Norge	24,4	6,9 %	20 %	15 %	25 %	Oslo Børs Totalindeks (OSEBX)
Europa	11,8	3,4 %	10 %	5 %	15 %	MSCI Europa Indeks NR*
Global valutasikra	8,9	2,5 %	7,5 %	2,5 %	12,5 %	MSCI World 100% Hedged NOK ND
Global	26,3	7,5 %	22,5 %	17,5 %	27,5 %	MSCI AC World Indeks NR*
Sum aksjar og rente	352,1	100 %	100 %			
* Portefølje er under oppbygging, aksjefond vil ha sekvensiell inngang i 6 månader.						
Porteføljefordeling/målsatt vektor vil difor først vere riktige frå okotber 2024						