

Lífeyrissjóður starfsmanna Reykjavíkurborgar

Fjárfestingarstefna fyrir árið 2018

Kynning fyrir borgarráð 23.11.17





Helstu verkefni okkar frá því síðast.....



- Úrbóta og umbótavinna
- Byggja upp þekkingu i sjóðnum
 - Uppbygging áhættustýringu
 - Uppbygging á eignastýringu
 - Styrking fjármálasviðs
- Hagræðing til lengri tíma
- Innleiðing á nýju réttindakerfi
- Innleiðing á nýjum upplýsingakerfum
- Líkanasmíði – tryggingafræðileg úttekt
- Breyting á A deildinni hjá Brú lífeyrissjóði



Helstu verkefni framundan.....



- Stjórnarhættir – árangursmat stjórnar
- Siðferðisleg viðmið í fjárfestingum
 - Sjálfbærni – samfélagsleg ábyrgð
- Uppgjör á skuldbindingum á móti „Landsvirkjunarbréfum“
 - Lækkar framlag Reykjavíkurborgar 600 millj.kr. á ári
- Ferlavinna



LsRb - Fjárfestingarstefna fyrir árið 2018



Fjárfestingaflokkun FME	Eign LsRb 30.9.17	Stefna 2017	Hlf.%	Stefna 2018	Neðri vikmörk	Efri vikmörk	Innlent	Erlent	Verðtr.	Skráð
A.a Ríkisvixlar og skuldabréf	44.309.380.645	64%	58,7%	55%	30%	70%	43.717.433.591	591.947.054	92,3%	42,0%
A.b Fasteignaveðtryggð skuldabréf	1.040.953.586	1%	1,4%	2%	0%	10%	1.040.953.586	0	100,0%	0,0%
B.a Skuldabréf sveitarfélaga	6.491.484.297	10%	8,6%	9%	5%	15%	6.491.484.297	0	100,0%	41,4%
B.b Innlán	450.428.682	0%	0,6%	0%	0%	10%	404.762.446	45.666.236	0,0%	100,0%
B.c Sértryggð skuldabréf	5.225.582.536		6,9%	8%	4%	15%	5.225.582.536	0	73,5%	100,0%
Skuldabréf og vixlar lánastofnana og váttryggingafélaga,										
C.a að undanskildum víkjandi skuldabréfum	875.522.711	6%	1,2%	2%	0%	5%	875.522.711	0	16,8%	99,9%
C.b.a Hlutdeildarskírteini og hlutir í UCITS - skuldabréf	0		0,0%	0%	0%	10%	0	0	0,0%	0,0%
C.b.b Hlutdeildarskírteini og hlutir í UCITS - hlutabréf	3.329.611.318	4%	4,4%	5%	0%	10%	2.021.062.867	1.308.548.451	0,0%	39,3%
Skuldabréf og peningamarkaðsskjöl félaga og víkjandi										
D.a skuldabréf lánastofnana og váttryggingafélaga	5.053.119.354		6,7%	7%	0%	10%	4.982.012.188	71.107.166	95,6%	86,3%
Skuldabréf og peningamarkaðsskjöl annarra sjóða um										
D.b sameiginlega fjárfestingu	2.584.143.488		3,4%	4%	0%	10%	2.584.143.488	0	75,5%	75,5%
E.a Hlutabréf félaga	3.869.696.601	5%	5,1%	5%	0%	15%	3.800.286.560	69.410.041	0,0%	100,0%
Hlutdeildarskírteini og hlutir annarra sjóða um										
E.b.a sameiginlega fjárfestingu - fagfjárfestasjóðir	603.520.445		0,8%	1%	0%	5%	603.520.445	0	0,0%	0,0%
Hlutdeildarskírteini og hlutir annarra sjóða um										
E.b.b sameiginlega fjárfestingu - fjárfestingasjóðir	1.651.786.487		2,2%	2%	0%	10%	1.651.786.487	0	0,0%	0,0%
E.c Fasteignir	0	0%	0,0%	0%	0%	10%	0	0	0,0%	0,0%
F.a Afleiður	0		0,0%	0%	0%	10%	0	0	0,0%	0,0%
F.b Aðrir fjármálagerningar, þó ekki afleiður	0		0,0%	0%	0%	10%	0	0	0,0%	0,0%
Önnur verðbréf (í stefnu 2017)		10%								
Samtals:	75.485.230.151	100%	100%	100%			73.398.551.203	2.086.678.948	89,6%	52,1%
Hlf af safni							97,2%	2,8%	78,4%	52,1%

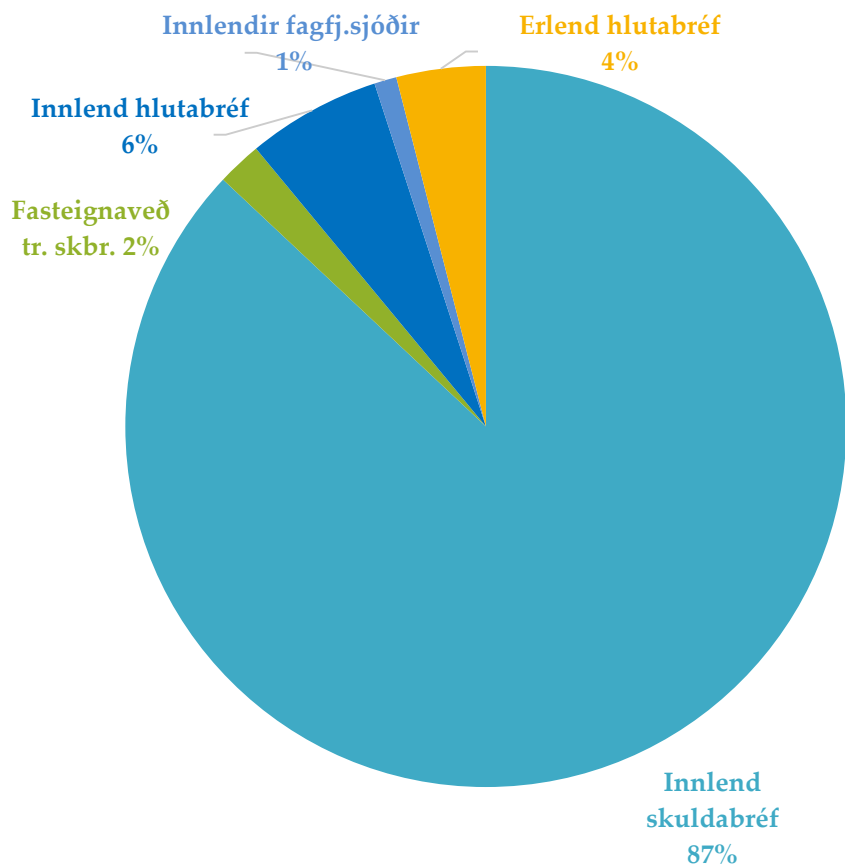
Fjárfestingarstefna LsRb fyrir árið 2018 er sett upp miðað við þá fjárfestingaflokkun sem Fjármálaeftirlitið hefur gefið út í nýrri reglugerð.

Til viðbótar bætum við undirflokkunum C.b.a. og C.b.b. og E.b.a. og E.b.b. til þess að gera skiptinguna skýrari.

Til þess að gefa ítarlegri sýn er eignastaðan í krónum jafnframt sýnd sem og skipting á milli innlendra og erlendra eigna, verðtryggðra og óverðtryggðra og skráðra og óskráðra.



LsRb – Samandregin stefna fyrir árið 2018



	Staða 30.9.2017	Stefna 2018
Skuldabréf og innlán	89,7%	89%
Innlend skuldabréf	87,3%	87%
Erlend skuldabréf	0,9%	0%
Fasteignaveðtryggð skuldabréf	1,4%	2%
Hlutabréf og fagfjárfestasjóðir	10,3%	11%
Innlend hlutabréf	7,7%	6%
Innlendir fagfjárfestasjóðir	0,8%	1%
Erlend hlutabréf	1,8%	4%
Samtals:	100,0%	100%