

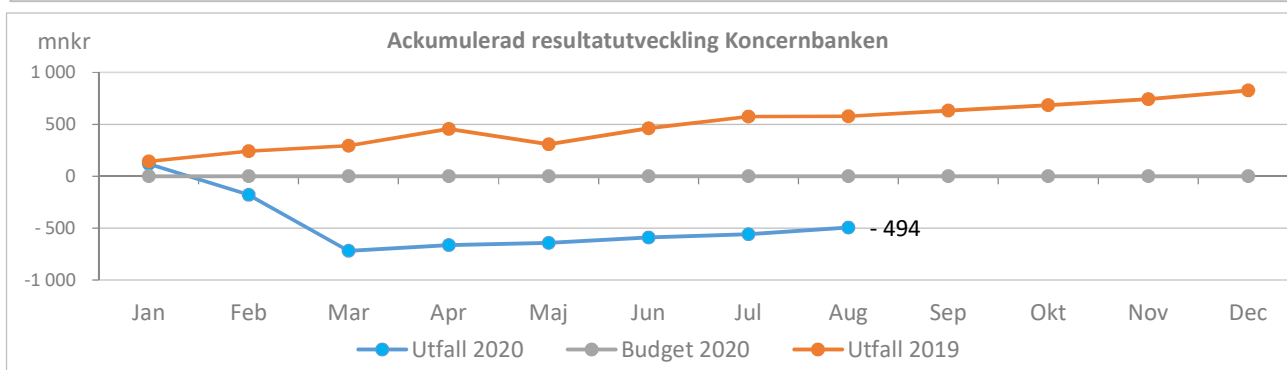
Koncernbankens resultat för augusti är -494 mnkr. Det negativa resultatet beror främst på att de finansiella marknaderna utvecklades negativt under våren i samband med pandemin. De kraftiga börsfallen har medfört att försäljningar gjordes under våren för att minska riskerna i portföljerna. Försäljningarna har påverkat periodens resultat för koncernbanken med -583 mnkr.

Likviditeten per augusti är 12,6 mdkr.

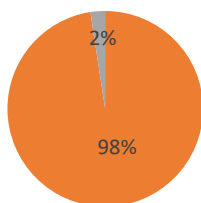
Den korta portföljen innehåller räntefonder. Avkastningen till och med augusti är -2,0%, vilket beror på pandemins effekter på räntemarknaden som innan den stabiliserades påverkades starkt negativt. Den långa portföljen placerar även i aktiefonder och avkastningen är -5,0% och även den portföljen har påverkats av vårens börsfall. Stiftelseportföljen har en längre placeringshorisont med en större andel aktiefonder och har avkastat 0,8%. Avkastningen inkluderar även utdelning.

Den korta portföljen har ett negativt övervärde (marknadsvärde minus anskaffningsvärde). Den långa portföljen har ett övervärde på 221 mnkr. Stiftelseportföljen har ett övervärde på 47 mnkr.

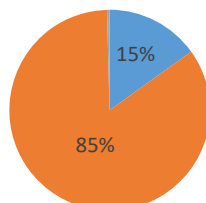
Inga överträdelser av finanspolicyn i augusti.



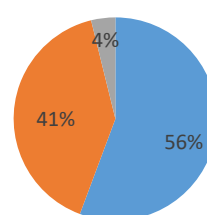
Kort likviditetsportfölj



Lång likviditetsportfölj



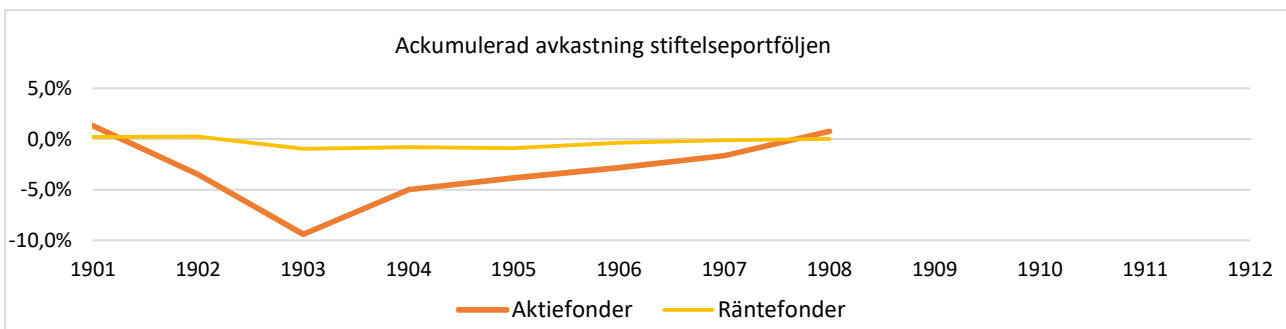
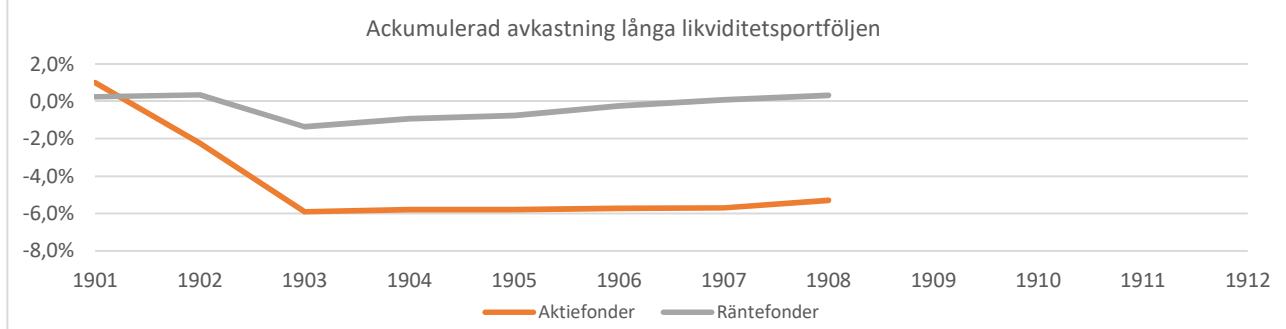
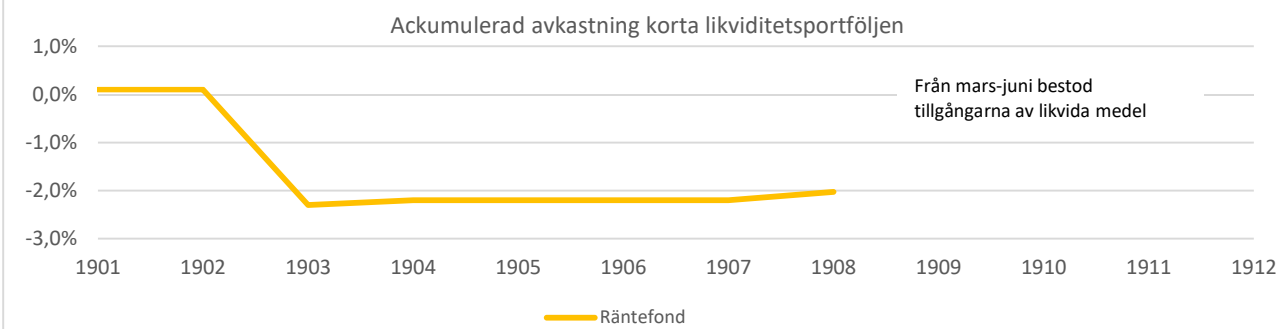
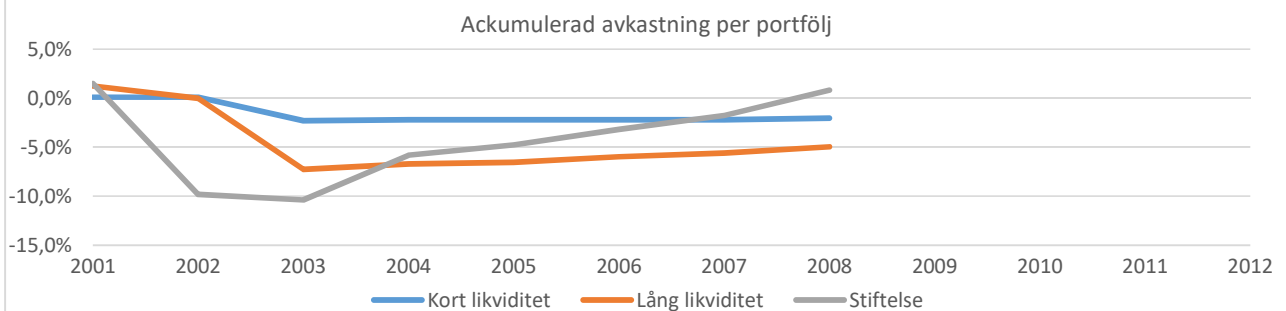
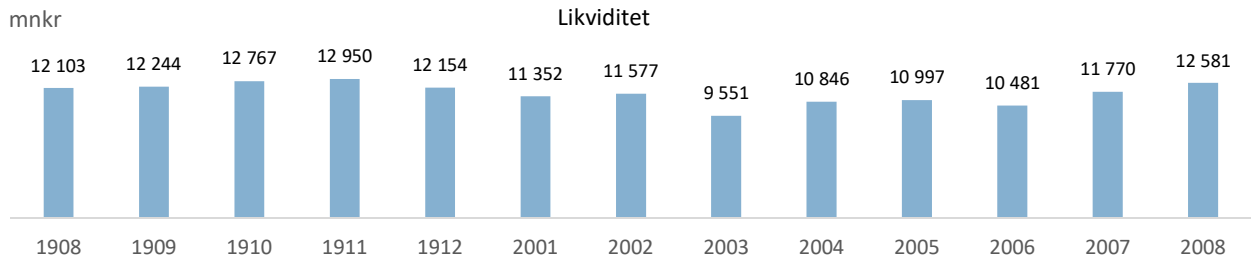
Stiftelseportfölj

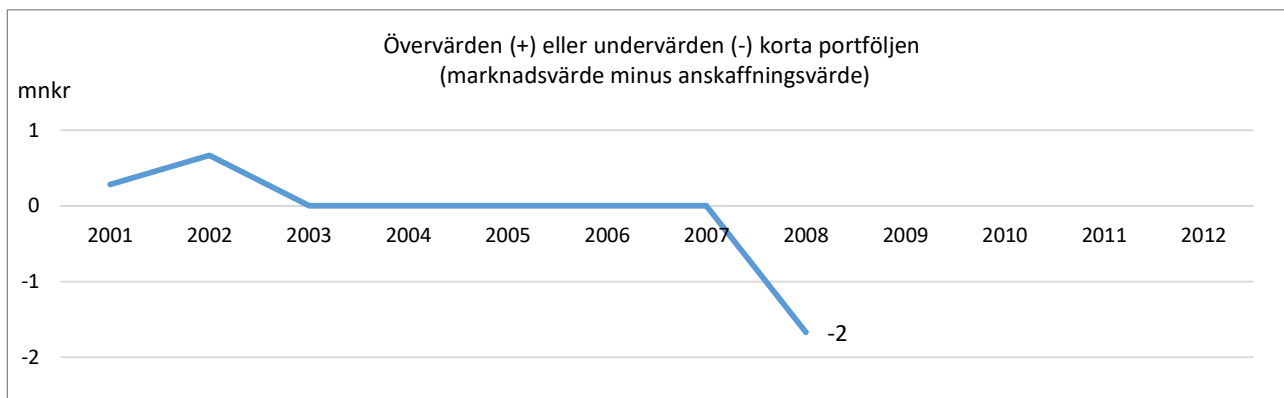


■ Aktiefond ■ Ränta ■ Likv medel

Marknadsvärde

Augusti mnkr	Kort likv- portfölj	Lång likv- portfölj	Totalt kort+lång	Total Andel	Stiftelse- portfölj
Aktiefonder	0	1373	1373	13%	342
Räntepapper	1498	7702	9201	86%	249
Likvida medel	38	38	76	1%	23
Total	1536	9114	10650	100%	614





Geografisk fördelning av aktierisken - långa likviditetsportföljen

Nordamerika	Sverige	V Europa	Asien exkl Japan	Japan	Australie n & NZ	Latin- amerika	Ö Europa	Afrika & Mö	Totalt
41,6%	29,0%	14,6%	7,8%	5,0%	0,9%	0,6%	0,3%	0,2%	100%

Uppföljning av limiter

(källa: KPMG)

Aug

Kort likviditetsportfölj	✓
Lång likviditetsportfölj	✓
Stiftelseportfölj	✓

