

Halvårsrapport Tredje AP-fonden 2016

AP3 2016 januari - juni i sammandrag

- Fondens resultat första halvåret 2016 uppgick till 4 206 (18 483) miljoner kronor.
- AP3s fondkapital uppgick till 304 021 (303 031 vid årsskiftet) miljoner kronor, vilket var en ökning med 990 (16 066) miljoner kronor.
- Från fondkapitalet har 3 216 (2 417) miljoner kronor betalats till Pensionsmyndigheten för att täcka skillnaden mellan inbetalda pensionsavgifter och utbetalda pensioner under första halvåret 2016.
- AP3s totalavkastning uppgick till 1,5 (6,5) procent före kostnader och 1,4 (6,4) procent efter kostnader. Riskklasserna Inflation, Räntor och Valuta stod för de största positiva bidragen till fondens resultat.
- Fonden har avkastat 8,3 procent i genomsnitt per år den senaste femårsperioden och 5,7 procent under den senaste 10-årsperioden. Inkomstindex för samma perioder uppgick till 1,8 respektive 2,5 procent per år. AP3s resultat har därmed väsentligt bidragit till pensionssystemet genom en betydligt högre tillväxt av kapitalet än ökningen av inkomstindex, som pensionerna skrivs upp med.
- Den reala avkastningen, dvs avkastningen efter avdrag för inflationen, var 7,9 procent per år för den senaste femårsperioden och 4,6 procent för den senaste tioårsperioden. Sedan start uppgår den reala snittavkastningen till 4,1 procent per år. Fonden har således överträffat sitt reala avkastningsmål om 4 procent i genomsnitt per år över tid.
- Fondens förvaltningskostnadsandel uppgick till 0,12 (0,12) procent, varav rörelsekostnader 0,06 (0,06) procent.
- Under första halvåret var avkastningen på AP3s portfölj 0,3 procentenheter lägre än jämförelseportföljen (LSP). Fonden har överträffat LSP med 2,9 procentenheter per år över en längre period, dvs sedan denna jämförelseportfölj introducerades 2012.
- För att möta ökade krav på långsiktigt hållbara investeringar och de klimatmål som signerades i Paris 2015 av Sverige har AP3 satt upp hållbarhetsmål som ska uppnås till 2018. Dessa omfattar bland annat mätning och minskning av koldioxidbelastningen i portföljen samt ytterligare investeringar i gröna obligationer.

Sammandrag av Tredje AP-fondens resultat per 30 juni, 2016:

	30/6-2016	30/6-2015	31/12-2015
Utgående fondkapital, mkr	304 021	304 398	303 031
Periodens/årets resultat, mkr	4 206	18 483	19 643
Nettoflöden till pensionssystemet, mkr	3 216	2 417	4 944
Ingående fondkapital, mkr	303 031	288 332	288 332
Förvaltningskostnadsandel Rörelsens kostnader, procent *	0,06	0,06	0,06
Förvaltningskostnadsandel inkl Provisionskostnader, procent *	0,12	0,12	0,12
Avkastning efter kostnader, procent	1,4	6,4	6,8
Annualiserad avkastning efter kostnader 5,0 år, procent **	8,3	9,3	8,4
Annualiserad avkastning efter kostnader 10,0 år, procent **	5,7	6,0	5,7

*Vid halvårsrapport beräknas kostnadsandelen som helårseffekt

**Även vid halvårsrapporter beräknas den annualiserade avkastningen för 10,0 resp 5,0 år

Resultaträkning

Rörelsens intäkter			
Mkr	Jan-juni 2016	Jan-juni 2015	Jan-dec 2015
Räntenetto	568	725	1 559
Erhållna utdelningar	4 474	3 569	4 644
Nettoresultat, noterade aktier och andelar	-4 930	8 132	4 418
Nettoresultat, onoterade aktier och andelar	545	3 143	6 636
Nettoresultat, räntebärande tillgångar	4 025	158	-189
Nettoresultat, derivatinstrument	-701	-649	-873
Nettoresultat, valutakursförändringar	403	3 585	3 811
Provisionskostnader	-86	-84	-170
Summa rörelsens intäkter	4 297	18 579	19 836
Rörelsens kostnader			
Personalkostnader	61	62	115
Övriga administrationskostnader	31	34	77
Summa rörelsens kostnader	91	96	192
Årets resultat	4 206	18 483	19 643

Balansräkning

TILLGÅNGAR			
Mkr	2016-06-30	2015-06-30	2015-12-31
Aktier och andelar			
Noterade	146 985	144 378	143 642
Onoterade	41 436	41 805	39 196
Obligationer och andra räntebärande tillgångar	133 246	139 492	132 373
Derivat	4 287	5 455	5 460
Kassa och bankmedel	1 072	1 386	1 780
Övriga tillgångar	10 533	21 181	11 569
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	1 004	1 203	1 083
Summa tillgångar	338 563	354 899	335 101
FONDKAPITAL OCH SKULDER			
Skulder			
Derivat	6 059	4 237	3 071
Övriga skulder	28 349	46 219	28 920
Förutbetalda intäkter och upplupna kostnader	133	46	79
Summa skulder	34 542	50 501	32 070
Fondkapital			
Ingående fondkapital	303 031	288 332	288 332
Nettobetalingar mot pensionssystemet	-3 216	-2 417	-4 944
Årets resultat	4 206	18 483	19 643
Summa fondkapital	304 021	304 398	303 031
Summa fondkapital och skulder	338 563	354 899	335 101

För mer information kontakta:

Kerstin Hessius, VD Tredje AP-fonden, 08-555 17 100

Lil Larås Lindgren, Chef Kommunikation Tredje AP-fonden, 08 555 17 123 eller lil.lindgren@ap3.se

Tredje AP-fonden (AP3) är en av fem buffertfonder med uppdrag att förvalta buffertkapitalet i det statliga inkomstpensionssystemet till största möjliga nytta för pensionssystemet. Fondkapitalet uppgick per den 30 juni 2016 till 304 miljarder kronor. Sedan nuvarande pensionssystem grundades 2001 har fonden täckt underskott i systemet med 20 miljarder kronor. Vid starten hade fonden ett kapital på 134 miljarder kronor. Sedan 2001 har fondens totalavkastning i snitt uppgått till 5,4 procent per år medan inkomstindex, vilket pensionerna skrivs upp med, har stigit med 2,8 procent per år.

AP3s hållbarhetsarbete presenterades i Tredje AP-fondens årsredovisning och hållbarhetsrapport 2015 och finns även att ladda ned från fondens hemsida www.ap3.se.