

Innehav i Länsförsäkringar Livs tre förvaltningsportföljer

-per årsskiftet 2023/2024

Innehåll

Sida

3	Innehav Nya Trad
4	Innehav Gamla Trad
5	Innehav Nya Världen
6	Summering Länsförsäkringar Liv



Här visas de största innehaven i Länsförsäkringar Livs tre förvaltningsportföljer uppdelat på:

- räntebärande placeringar
- aktieexponering via fonder
- onoterade fastigheter
- alternativa investeringar.

Aktieexponering via fonder har även genomlysts och här presenterad de 10 största enskilda innehaven.

Uppgifterna avser innehaven per 2023-12-31

Innehav Nya Trad

De största innehaven i Nya Trad per 2023-12-31

(Mkr)

Räntebärande placeringar

	Värde	Portföljandel
Stabelo Fund 1	1 629	5,8%
Skandinaviska Enskilda Banken	999	3,6%
Europeiska Investeringsbanken	857	3,1%
Svenska Staten	750	2,7%
World Bank Group	629	2,3%
Norska Staten	536	1,9%
Övrigt räntebärande	4 526	16,2%
9 926	35,6%	

Aktieexponering via fonder

Länsförsäkringar USA Index	5 051	18,1%
Länsförsäkringar Sverige Index	4 504	16,2%
Länsförsäkringar Europa Index	1 250	4,5%
Övrigt aktiefonder	416	1,5%
11 221	40,2%	

Onoterade fastigheter

Humlegården fastigheter AB (publ)	1 048	3,8%
Övrigt fastigheter	1 314	4,7%
2 362	8,5%	

Alternativa investeringar

Private Equity	2 672	9,6%
Private Lending	1 329	4,8%
Övriga alternativa investeringar	373	1,3%
4 374	15,7%	

Totalt Nya Trad

27 883 **100,0%**

Genomlysning Aktiefonder, 10 största innehaven

Innehav	Mkr	Portföljandel
Apple Inc	477	1,7%
Microsoft Corp	353	1,3%
Atlas Copco, A	294	1,1%
Investor, B	291	1,0%
Nordea Bank Abp	280	1,0%
Nvidia Corp	221	0,8%
Amazon.com Inc.	220	0,8%
Hexagon, B	202	0,7%
Assa Abloy, B	201	0,7%
Sandvik	183	0,7%

Räntebärande placeringar, såväl specificerade innehav som övriga räntebärande placeringar, utgörs av placeringar i främst hållbara obligationer och säkerställda obligationer med hög kvalitet och hög kreditvärdighet. De hållbara ränteplaceringarna bidrar till att finansiera den gröna omställningen i samhället. Allokering till bolånefonder ger motsvarande bolånerisk som säkerställda obligationer men med högre förväntad avkastning.

Aktieexponering tas genom investering i ett fåtal indexnära och hållbarhetsinriktade aktiefonder med exponering mot Sverige och övriga utvecklade marknader.

Fastighetsportföljen består till största delen av innehav i onoterade fastighetsbolag. Portföljen består av kontorsfastigheter, bostadsfastigheter, handelsfastigheter och samhällsfastigheter.

Exponering mot **Alternativa Investeringar** görs främst via onoterade Privat Equity fonder i syfte att ge portföljerna exponering mot illikviditetspremier samt tillvarata investeringsmöjligheter på den onoterade kredit- och aktiemarknaden.

Innehav Gamla Trad

De största innehaven i Gamla Trad per 2023-12-31

(Mkr)

Räntebärande placeringar	Värde	Portföljandel	Genomlysning Aktiefonder, 10 största innehaven	Värde	Portföljandel
Stabelo Fund 1	4 442	6,4%	Innehav		
Europeiska Investeringsbanken	4 324	6,2%	Apple Inc	553	0,8%
Svenska Staten	4 089	5,9%	Microsoft Corp	409	0,6%
Nordea Bank	3 476	5,0%	Atlas Copco, A	340	0,5%
Länsförsäkringar	3 036	4,3%	Investor, B	336	0,5%
Skandinaviska Enskilda Banken	2 526	3,6%	Nordea Bank Abp	323	0,5%
Svenska Handelsbanken	2 450	3,5%	Nvidia Corp	257	0,4%
Övrigt räntebärande	24 054	34,5%	Amazon.com Inc.	256	0,4%
	43 421	62,2%	Hexagon, B	233	0,3%
			Assa Abloy, B	232	0,3%
			Sandvik	212	0,3%
Aktieexponering via fonder					
Länsförsäkringar USA Index	5 860	8,4%			
Länsförsäkringar Sverige Index	5 199	7,4%			
Övrigt aktiefonder	1 931	2,8%			
	12 990	18,6%			
Onoterade fastigheter					
Humlegården fastigheter AB (publ)	2 412	3,5%			
Övrigt fastigheter	3 040	4,4%			
	5 452	7,8%			
Alternativa investeringar					
Private Equity	3 629	5,2%			
Private Lending	3 386	4,8%			
Övriga alternativa investeringar	939	1,3%			
	7 954	11,4%			
Totalt Gamla Trad	69 817	100,0%			

Räntebärande placeringar, såväl specificerade innehav som övriga räntebärande placeringar, utgörs av placeringar i främst hållbara obligationer och säkerställda obligationer med hög kvalitet och hög kreditvärdighet. De hållbara ränteplaceringarna bidrar till att finansiera den gröna omställningen i samhället. Allokering till bolänefonder ger motsvarande bolånerisk som säkerställda obligationer men med högre förväntad avkastning.

Aktieexponering tas genom investering i ett fåtal indexnära och hållbarhetsinriktade aktiefonder med exponering mot Sverige och övriga utvecklade marknader.

Fastighetsportföljen består till största delen av innehav i onoterade fastighetsbolag. Portföljen består av kontorsfastigheter, bostadsfastigheter, handelsfastigheter och samhällsfastigheter.

Exponering mot **Alternativa Investeringar** görs främst via onoterade Privat Equity fonder i syfte att ge portföljerna exponering mot illikviditetspremier samt tillvarata investeringsmöjligheter på den onoterade kredit- och aktiemarknaden.

Innehav Nya Världen

De största innehaven i Nya Världen per 2023-12-31

(Mkr)

Räntebärande placeringar

World Bank Group	300	3,7%
Kommuninvest	244	3,0%
Asian Development Bank	229	2,8%
Svenska Staten	229	2,8%
Skandinaviska Enskilda Banken	216	2,6%
Landshypotek	150	1,8%
Övrigt räntebärande	1 439	17,6%

Värde Portföljandel

2 441	29,9%
--------------	--------------

Aktieexponering via fonder

Länsförsäkringar USA Index	2 879	35,3%
Länsförsäkringar Sverige Index	1 897	23,2%
Länsförsäkringar Europa Index	712	8,7%
Länsförsäkringar Japanfond (Index)	236	2,9%
Övrigt aktiefonder	1	0,0%

5 725 **70,1%**

Totalt Nya Världen

8 166 **100,0%**

Genomlysning Aktiefonder, 10 största innehaven

Innehav	Värde	Portföljandel
Apple Inc	272	3,3%
Microsoft Corp	201	2,5%
Nvidia Corp	126	1,5%
Amazon.com Inc.	126	1,5%
Atlas Copco, A	124	1,5%
Investor, B	123	1,5%
Nordea Bank Abp	118	1,4%
Hexagon, B	85	1,0%
Assa Abloy, B	85	1,0%
Sandvik	77	0,9%

Räntebärande placeringar, såväl specificerade innehav som övriga räntebärande placeringar, utgörs av placeringar i främst hållbara obligationer och säkerställda obligationer med hög kvalitet och hög kreditvärdighet. De hållbara ränteplaceringarna bidrar till att finansiera den gröna omställningen i samhället. Allokering till bolänefonder ger motsvarande bolånerisk som säkerställda obligationer men med högre förväntad avkastning.

Aktieexponering tas genom investering i ett fåtal indexnära och hållbarhetsinriktade aktiefonder med exponering mot Sverige och övriga utvecklade marknader.

De största innehaven i Länsförsäkringar Liv

- per 2023-12-31

(Mkr)

	Värde	Portföljandel	Genomlysning Aktiefonder, 10 största innehaven	Värde	Portföljandel
Räntebärande placeringar			Innehav		
Stabelo Fund 1	6 072	5,7%	Apple Inc	1301	1,2%
Europeiska Investeringsbanken	5 262	5,0%	Microsoft Corp	963	0,9%
Svenska Staten	5 068	4,8%	Atlas Copco, A	758	0,7%
Skandinaviska Enskilda Banken	3 741	3,5%	Investor, B	749	0,7%
Nordea Bank	3 665	3,5%	Nordea Bank Abp	721	0,7%
Länsförsäkringar	3 125	3,0%	Nvidia Corp	605	0,6%
Övrigt räntebärande	29 031	27,4%	Amazon.com Inc.	602	0,6%
	55 964	52,9%	Hexagon, B	521	0,5%
			Assa Abloy, B	518	0,5%
			Sandvik	472	0,4%
Aktieexponering via fonder					
Länsförsäkringar USA Index	13 789	13,0%			
Länsförsäkringar Sverige Index	11 600	11,0%			
Länsförsäkringar Europa Index	3 407	3,2%			
Övrigt aktiefonder	1 140	1,1%			
	29 936	28,3%			
Onoterade fastigheter					
Humlegården fastigheter AB (publ)	3 461	3,3%			
Övrigt fastigheter	4 353	4,1%			
	7 814	7,4%			
Alternativa investeringar					
Private Equity	6 301	6,0%			
Private Lending	3 386	3,2%			
Övriga alternativa investeringar	2 640	2,5%			
	12 327	11,6%			
Totalt Förvaltad kapital	105 866	100,0%			

Räntebärande placeringar, såväl specificerade innehav som övriga räntebärande placeringar, utgörs av placeringar i främst hållbara obligationer och säkerställda obligationer med hög kvalitet och hög kreditvärdighet. De hållbara ränteplaceringarna bidrar till att finansiera den gröna omställningen i samhället. Allokering till bolänsfonder ger motsvarande bolänsrisk som säkerställda obligationer men med högre förväntad avkastning.

Aktieexponering tas genom investering i ett fåtal indexnära och hållbarhetsinriktade aktiefonder med exponering mot Sverige och övriga utvecklade marknader.

Fastighetsportföljen består till största delen av innehav i onoterade fastighetsbolag. Portföljen består av kontorsfastigheter, bostadsfastigheter, handelsfastigheter och samhällsfastigheter.

Exponering mot **Alternativa Investeringar** görs främst via onoterade Privat Equity fonder i syfte att ge portföljerna exponering mot illikviditetspremier samt tillvarata investeringsmöjligheter på den onoterade kredit- och aktiemarknaden.