



## Fjármagnaður útblástur

Samandregnar niðurstöður fyrir hlutabréfasjóði, skuldabréfasjóði og blandaða sjóði

### Hlutabréfasjóðir

|      | Umfang 1& 2<br>(kt CO <sub>2</sub> eq) | Samtals<br>(ISKm) | Losunarstyrkur<br>(t CO <sub>2</sub> eq/ISKm) | Gagnagæði |
|------|----------------------------------------|-------------------|-----------------------------------------------|-----------|
| 2020 | 2,19                                   | 13 .272           | 0,165                                         | 1,82      |
| 2021 | 8,61                                   | 28.234            | 0,304                                         | 1,66      |

\***Ekki meðtalið:** IS Heimssafn (árslok 2020 1.188mkr og árslok 2021 1.408mkr)

### Skuldabréfasjóðir

|      | Umfang 1& 2<br>(kt CO <sub>2</sub> eq) | Samtals<br>(ISKm) | Losunarstyrkur<br>(t CO <sub>2</sub> eq/ISKm) | Gagnagæði |
|------|----------------------------------------|-------------------|-----------------------------------------------|-----------|
| 2020 | 63,64                                  | 161 .460          | 0,394                                         | 2,90      |
| 2021 | 63,37                                  | 154 .430          | 0,410                                         | 3,10      |

### Blandaðir sjóðir

|      | Umfang 1& 2<br>(kt CO <sub>2</sub> eq) | Samtals<br>(ISKm) | Losunarstyrkur<br>(t CO <sub>2</sub> eq/ISKm) | Gagnagæði |
|------|----------------------------------------|-------------------|-----------------------------------------------|-----------|
| 2020 | 8,77                                   | 21 .490           | 0,408                                         | 2,62      |
| 2021 | 17 ,39                                 | 35.762            | 0,486                                         | 2,72      |

**Ekki meðtalið:** IS Einkasafn Erlent (árslok 2020 2.901mkr og árslok 2021 4.222mkr)

**Hlutabréfasjóðirnir** fjárfesta að mestu í innlendum hlutabréfum. Þrír af fjórum hlutabréfasjóðum Íslandssjóða mynda töluleg gögn en ekki var hægt að reikna út fjármagnaðan útblástur IS Heimssafn vegna takmarkaðra gagna fyrir erlend verðbréf sjóðsins. Losunarstyrkleiki IS Hlutabréfasjóðsins er tiltölulega lágur, en hækkar á milli ára vegna hærri fjárfestinga á árinu 2021 í félögum með mikinn útblástur.

**Skuldabréfasjóðirnir** fjárfesta að mestu í innlendum skuldabréfum. Þau eru annars vegar verðtryggð eða óverðtryggt og ýmist með eða án ríkisábyrgðar. Ef horft er yfir heildina má sjá að almennt eru skuldabréfasjóðirnir með hærri útblástur en hlutabréfasjóðirnir. Losunarstyrkurinn er þá hærri hjá þeim sjóðum þar sem vægi fjárfestinga í ríkisskuldabréfum er hærra.

**Blandaðir sjóðir** Íslandssjóða leggja áherslu á dreifð eignasöfn þar sem áhættunni er dreift á milli nokkurra eignaflokka á borð við hlutabréf, skuldabréf og innlán. Sjö af átta blönduðu sjóðum Íslandssjóða mynda töluleg gögn en ekki var hægt að reikna út fjármagnaðan útblástur IS Einkasafn Erlent vegna takmarkaðra gagna fyrir erlend verðbréf sjóðsins. Líkt og í tilfelli hinna tveggja flokkanna, þá er losunarstyrkur blönduðu sjóðanna hærri árið 2021 en árið áður. Megin ástæður þess eru meiri fjárfestingar í ríkisskuldabréfum á seinna árinu ásamt stærri fjárfestingum í félögum með mikinn útblástur.

|                                                                                           | 2020           |                                            |              |                        |                             |                                |             | 2021           |                                            |              |                        |                             |                                |             |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------------------------|--------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-------------|----------------|--------------------------------------------|--------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-------------|
|                                                                                           | Eignir alls    | Innan umfangs fyrir fjármagnaðan útblástur | Utan umfangs | Útblástur              | Styrkur                     | % af eignasafni í útreikningum | Gagnagæði   | Eignir alls    | Innan umfangs fyrir fjármagnaðan útblástur | Utan umfangs | Útblástur              | Styrkur                     | % af eignasafni í útreikningum | Gagnagæði   |
| Hlutabréfasjóðir                                                                          | (ISK m)        | (ISK m)                                    | (ISK m)      | (kt CO <sub>2</sub> e) | (tCO <sub>2</sub> e / ISKm) |                                |             | (ISK m)        | (ISK m)                                    | (ISK m)      | (kt CO <sub>2</sub> e) | (tCO <sub>2</sub> e / ISKm) |                                |             |
| IS Úrvalsvisitölusjóður                                                                   | 2,244          | 2,244                                      | -            | 0.10                   | 0.044                       | 100%                           | 1.84        | 3,245          | 3,245                                      | -            | 0.73                   | 0.225                       | 100%                           | 1.68        |
| IS Hlutabréfasjóðurinn                                                                    | 6,723          | 6,682                                      | 42           | 1.20                   | 0.179                       | 99.4%                          | 1.83        | 10,147         | 10,037                                     | 110          | 3.13                   | 0.312                       | 98.9%                          | 1.67        |
| IS EQUUS Hlutabréf                                                                        | 4,430          | 4,346                                      | 84           | 0.89                   | 0.205                       | 98.1%                          | 1.80        | 15,312         | 15,061                                     | 251          | 4.75                   | 0.316                       | 98.4%                          | 1.64        |
| Samtals                                                                                   | 13,397         | 13,272                                     | 126          | 2.19                   | 0.165                       |                                | 1.82        | 28,704         | 28,343                                     | 361          | 8.61                   | 0.304                       |                                | 1.66        |
| <b>*Ekki meðtalið:</b> IS Heimssafn (árslok 2020 1,188mkr og árslok 2021 1,408mkr)        |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |
| Skuldabréfasjóðir                                                                         |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |
| IS Lausafjár safn                                                                         | 54,330         | 54,330                                     | -            | 7.76                   | 0.143                       | 100%                           | 1.50        | 38,506         | 38,506                                     | -            | 8.39                   | 0.218                       | 100%                           | 1.86        |
| IS Veltusafn                                                                              | 8,414          | 8,414                                      | -            | 4.11                   | 0.489                       | 100%                           | 2.94        | 10,404         | 10,404                                     | -            | 4.94                   | 0.475                       | 100%                           | 2.96        |
| IS Ríkissafn - ríkisskuldabréf                                                            | 13,275         | 13,275                                     | -            | 10.07                  | 0.758                       | 100%                           | 4.58        | 14,199         | 14,199                                     | -            | 10.20                  | 0.719                       | 100%                           | 4.56        |
| IS Ríkisskuldabréf meðallöng                                                              | 27,880         | 27,880                                     | -            | 18.66                  | 0.669                       | 100%                           | 4.50        | 25,928         | 25,928                                     | -            | 15.99                  | 0.617                       | 100%                           | 4.52        |
| IS Ríkisskuldabréf löng                                                                   | 19,011         | 19,011                                     | -            | 11.69                  | 0.615                       | 100%                           | 4.43        | 20,054         | 20,054                                     | -            | 11.58                  | 0.578                       | 100%                           | 4.44        |
| IS Skuldabréfasafn                                                                        | 5,797          | 5,797                                      | -            | 0.84                   | 0.145                       | 100%                           | 2.59        | 6,663          | 6,295                                      | 368          | 0.69                   | 0.110                       | 94.5%                          | 2.12        |
| IS Ríkisskuldabréf óverðtryggð                                                            | 4,226          | 4,226                                      | -            | 4.86                   | 1.107                       | 100%                           | 4.91        | 5,200          | 5,200                                      | -            | 4.98                   | 0.958                       | 100%                           | 4.79        |
| IS Sértryggð skuldabréf                                                                   | 10,652         | 10,652                                     | -            | 2.35                   | 0.221                       | 100%                           | 1.92        | 11,434         | 11,434                                     | -            | 2.40                   | 0.210                       | 100%                           | 1.95        |
| IS Sértryggð skuldabréf VTR                                                               | 14,037         | 14,037                                     | -            | 2.42                   | 0.173                       | 100%                           | 1.88        | 18,218         | 18,218                                     | -            | 3.40                   | 0.187                       | 100%                           | 1.95        |
| IS Græn skuldabréf                                                                        | 3,838          | 3,838                                      | -            | 1.06                   | 0.276                       | 100%                           | 2.51        | 4,232          | 4,192                                      | 41           | 0.80                   | 0.191                       | 99.0%                          | 2.37        |
| Samtals                                                                                   | 161,460        | 161,460                                    | -            | 63.64                  | 0.394                       |                                | 2.90        | 154,838        | 154,430                                    | 409          | 63.37                  | 0.410                       |                                | 3.10        |
| Blandaðir sjóðir                                                                          |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |
| IS Einkasafn A                                                                            | 4,350          | 4,350                                      | -            | 1.86                   | 0.427                       | 100%                           | 2.89        | 3,028          | 3,028                                      | -            | 1.52                   | 0.501                       | 100%                           | 3.29        |
| IS Einkasafn B                                                                            | 6,745          | 6,613                                      | 132          | 2.75                   | 0.417                       | 98.0%                          | 2.70        | 6,660          | 6,524                                      | 136          | 3.17                   | 0.486                       | 98.0%                          | 2.99        |
| IS Einkasafn C                                                                            | 6,617          | 6,369                                      | 249          | 2.50                   | 0.392                       | 96.2%                          | 2.46        | 16,088         | 15,545                                     | 542          | 7.46                   | 0.480                       | 96.6%                          | 2.72        |
| IS Einkasafn D                                                                            | 2,268          | 2,139                                      | 129          | 0.77                   | 0.362                       | 94.3%                          | 2.17        | 6,781          | 6,405                                      | 376          | 3.0                    | 0.469                       | 94.5%                          | 2.36        |
| IS Einkasafn E                                                                            | 750            | 689                                        | 61           | 0.22                   | 0.323                       | 91.8%                          | 1.91        | 2,928          | 2,614                                      | 314          | 1.37                   | 0.524                       | 89.3%                          | 1.93        |
| IS Eignasafn                                                                              | 803            | 769                                        | 33           | 0.31                   | 0.401                       | 95.9%                          | 2.68        | 1,163          | 1,113                                      | 51           | 0.57                   | 0.510                       | 95.7%                          | 2.90        |
| IS Eignasafn - Ríki og sjóðir                                                             | 561            | 561                                        | -            | 0.36                   | 0.635                       | 100%                           | 3.98        | 533            | 533                                        | -            | 0.30                   | 0.557                       | 100%                           | 4.01        |
| Samtals                                                                                   | 22,094         | 21,490                                     | 604          | 8.77                   | 0.408                       |                                | 2.62        | 37,181         | 35,762                                     | 1,419        | 17.39                  | 0.486                       |                                | 2.72        |
| <b>*Ekki meðtalið:</b> IS Einkasafn Erlent (árslok 2020 2,901mkr og árslok 2021 4,222mkr) |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |                |                                            |              |                        |                             |                                |             |
| <b>Samtals alls</b>                                                                       | <b>201,040</b> | <b>196,222</b>                             | <b>730</b>   | <b>74.6</b>            | <b>0.380</b>                | <b>97.6%</b>                   | <b>2.80</b> | <b>226,353</b> | <b>218,535</b>                             | <b>2,189</b> | <b>89.37</b>           | <b>0.409</b>                | <b>96.5%</b>                   | <b>2.85</b> |