

Information om placering och utförande av order – 2021

Skandia Investment Management Aktiebolag, org. nr 556606–6832 ("SIM") är Skandias Kapitalförvaltningsbolag som tillhandahåller diskretionär portföljförvaltning med stöd av lagen (2007:528) om värdepappersmarknaden till sina två koncerninterna kunder; Livförsäkringsbolaget Skandia, ömsesidigt och Skandia Fonder AB. Båda kunderna är professionella och behandlas som jämbördiga motparter.

Enligt Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/565 om organisatoriska krav och villkor för värdepappersföretag Artikel 65(6) ska SIM, årligen för varje klass av finansiella instrument offentliggöra information om de fem handelsplatser som baserat på handelsvolym använts mest för utförande av kundorder under föregående år. SIM ska årligen också för varje klass av finansiella instrument offentliggöra information om de fem mest använda värdepappersföretagen där SIM placerat kundorder under föregående år. Informationen ska också omfatta en separat redogörelse för de handelsplatser och/eller de värdepappersföretag där SIM placerat kundorder avseende värdepappersfinansieringstransaktioner. Informationen om de främsta handelsplatserna och värdepappersföretagen presenteras i detta dokument och finns även att tillgå i CSV-format på SIM:s hemsida, www.skandia.se/om-oss/om-skandia/finansiell-information/skandias-kapitalforvaltningsbolag/

SIM ska även offentliggöra en sammanfattning av den analys och slutsatserna som SIM gjort om kvaliteten på utförandet av order under föregående år. Sammanfattningen av analysen finns i nästa avsnitt av detta dokument.

Informationen i detta dokument avser kalenderåret 2021.

Analys av placering av order

Informationen i detta avsnitt gäller för samtliga klasser av finansiella instrument när inget annat anges. SIM har i enlighet med sin policy om bästa möjliga resultat och orderhantering lagt störst vikt vid följande faktorer vid placering av order.

För aktier, börshandlade fonder, depåbevis, börshandlade aktiederivat och råvaruderivat har SIM lagt störst vikt vid pris och kostnad för utförande av order, i andra hand sannolikheten för utförande och i tredje hand snabbheten för utförandet.

För obligationer, penningmarknadsinstrument, företagsobligationer, börshandlade räntederivat och valutaderivat har SIM lagt störst vikt vid pris och kostnad för utförande av order och i andra hand sannolikheten för utförande.

SIM har inga nära förbindelser, intressekonflikter eller gemensamma ägarskap avseende de handelsplatser/utförandeplatser eller värdepappersföretag hos vilka SIM har placerat order. Under föregående år mottog SIM inte några betalningar, rabatter eller icke-monetära förmåner från operatörer

av de handelsplatser/utförandeplatser eller värdepappersföretag som kundorder placerades hos. SIM kan dock ha mottagit mindre icke-monetära ersättningar från sådana operatörer eller värdepappersbolag i form av till exempel dokumentation av allmän karaktär om finansiella instrument eller investeringstjänster, deltagande i seminarier och andra informationsevenemang gällande egenskaper hos finansiella instrument eller viss investeringstjänst samt representation upp till ett rimligt värde.

I syfte att uppnå bästa möjliga resultat i enlighet med bolagets policy om bästa möjliga resultat och orderhantering utvärderar SIMs motpartskommitté regelbundet sin motpartpartslista ("Motpartslistan") över vilka värdepappersbolag SIM kan placera order hos för varje klass av finansiella instrument. Under året har två motparter tillkommit på motpartslistan för handel med företagsobligationer, efter överväganden av pris och kvalitet i orderutförandet. Vidare har en motpart för aktier adderats till motpartslistan. I detta fall som ett komplement till befintliga motparter, med global täckning som ger konkurrenskraftiga priser, även på större volymer. Slutligen har en motpart plockats bort från motpartslistan för handel med valutaderivat på grund av låga handelsvolymer.

Data enligt den delegerade förordningen (EU) 2017/575 har inte använts i analysen eftersom den enligt SIMs mening inte uppnått tillräckligt hög kvalitet för att vara användbar vid analysen av kvaliteten på utförandet av order i SIMs verksamhet. Konsoliderad handelsinformation har inte funnits tillgänglig på marknaden under 2021, varför SIM inte använt sig av sådan information i analysen av kvaliteten på utförandet av order.

Placering av order

Under föregående år har SIM utfört order direkt på handelsplatser för valutaderivat och obligationer. Övriga order placerades hos andra värdepappersföretag. Nedan framgår de mest använda värdepappersföretagen och handelsplatserna där SIM placerade flest order under föregående år.

Klass av instrument	Aktier - Aktier och depåbevis	
	(i) Tick-storlek - Likviditetsband 5 och 6	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
ABG Sundal Collier ASA	23,26%	12,40%
2138005DRCU66B8BNY04		
Nordea Bank Abp	20,82%	27,56%
529900ODI3047E2LIV03		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	14,27%	15,44%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Morgan Stanley Europe SE	10,11%	20,35%
54930056FHWP7GIWYY08		
BofA Securities SA	8,19%	2,86%
549300FHOWJAPEHTIQ77		
Klass av instrument	Aktier - Aktier och depåbevis	
	(ii) Tick-storlek - Likviditetsband 3 och 4	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
ABG Sundal Collier ASA	21,00%	26,14%
2138005DRCU66B8BNY04		
Carnegie Investment Bank AB	19,30%	7,09%
529900BR5NZNQZEVQ417		
Morgan Stanley Europe SE	16,18%	32,82%
54930056FHWP7GIWYY08		
Nordea Bank Abp	15,25%	19,84%
529900ODI3047E2LIV03		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	11,87%	4,54%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		

Klass av finansiella instrument	Aktier - Aktier och depåbevis	
	(iii) Tick-storlek - Likviditetsband 1 och 2	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Macquarie Capital (Europe) Ltd	36,24%	37,73%
549300GX4FPMFF91R37		
BofA Securities SA	29,51%	27,45%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Nordea Bank Abp	17,41%	17,24%
529900ODI3047E2LIV03		
Morgan Stanley Europe SE	13,40%	12,78%
54930056FHWP7GIWYY08		
ABG Sundal Collier ASA	1,31%	4,08%
2138005DRCU66B8BNY04		
Klass av instrument	Skuldinstrument	
	(i) Obligationer	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Danske Bank A/S	41,61%	41,97%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	27,19%	23,70%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Nordea Bank Abp	15,07%	11,27%
529900ODI3047E2LIV03		
Svenska Handelsbanken AB	9,09%	10,88%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Swedbank AB	5,69%	7,58%
M312WZV08Y7LYUC71685		

Klass av instrument	Skuldinstrument	
	(ii) Penningmarknadsinstrument	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	J	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Danske Bank A/S	56,60%	46,49%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Svenska Handelsbanken AB	29,63%	33,33%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Swedbank AB	5,93%	7,02%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Nordea Bank Abp	5,34%	7,89%
529900ODI3047E2LIV03		
DNB ASA	1,33%	2,63%
5967007LIEEXZX78M803		
Klass av instrument	Räntederivat	
	(i) Futures och optioner upptagna till handel på en handelsplats	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Citigroup Global Markets Ltd	45,63%	33,60%
XKZZZJZF41MRHTR1V493		
Societe Generale	33,43%	8,70%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
Danske Bank A/S	9,97%	19,76%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	4,67%	15,28%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Swedbank AB	2,50%	8,56%
M312WZV08Y7LYUC71685		

Klass av instrument	Räntederivat	
	(ii) Swappar, forwardkontrakt och andra räntederivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	J	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Skandinaviska Enskilda Banken AB	80,15%	56,25%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Nordea Bank Abp	7,60%	12,50%
529900ODI3047E2LIV03		
Swedbank AB	7,60%	6,25%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Danske Bank A/S	4,65%	25,00%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Klass av instrument	Valutaderivat	
	(ii) Swappar, forwardkontrakt och andra valutaderivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Danske Bank A/S	25,99%	16,90%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	19,74%	38,26%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Deutsche Bank AG	13,63%	10,80%
7LTWFZYICNSX8D621K86		
Swedbank AB	9,43%	5,75%
M312WZV08Y7LYUC71685		
BofA Securities SA	8,00%	5,40%
549300FHOWJAPEHTIQ77		

Klass av instrument	Valutaderivat	
	(ii) Swappar, forwardkontrakt och andra valutaderivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta handelsplatserna rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Bloomberg Trading Facility B.V.	100,00%	100,00%
254900QBKK4WBSO3GE51		
Klass av instrument	Aktiederivat	
	(i) Optioner och futures upptagna till handel på en handelsplats	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Citigroup Global Markets Europe AG	37,69%	37,01%
6TJCK1B7E7UTXP528Y04		
Danske Bank A/S	26,09%	39,61%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
BofA Securities Europe SA	18,77%	12,99%
549300FHOWJAPEHTIQ77		
Swedbank AB	7,92%	8,16%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	3,32%	1,67%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		

Klass av instrument	Aktiederivat	
	(ii) Swappar och andra aktiederivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	J	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Skandinaviska Enskilda Banken AB	95,06%	50,00%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities Europe SA	3,48%	31,25%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
J.P. Morgan AG	1,46%	18,75%
549300ZK53CNGEEI6A29		
Klass av instrument	Råvaruderivat och utsläppsderivat	
	(i) Optioner och futures upptagna till handel på en handelsplats	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	N	
De fem främsta värdepappersföretagen hos vilka order placerades rankade efter handelsvolym (fallande ordning)	Andel handlad volym som procentandel av den totala handelsvolymen i den klassen	Andel utförda order som procentandel av det totala antalet utförda order i den klassen
Citigroup Global Markets Europe AG	98,68%	99,91%
6TJCK1B7E7UTXP528Y04		
Societe Generale	1,32%	0,09%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		

