

Information om placering och utförande av order – 2024

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 MiFID II regelkrav 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, <https://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 2024.

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 SIM:s motpartskommitté regelbundet sin motpartpartslista ("Motpartslistan") över vilka värdepappersbolag SIM kan placera order hos för varje klass av finansiella instrument. Under året har fyra motparter tillkommit och tre plockats bort på motpartslistan för handel med räntebärande, efter överväganden av pris och sannolikhet för utförande. Vidare har en motpart tillkommit och en tagits bort på motpartslistan för handel med derivat efter överväganden av pris och sannolikhet för utförande.

Data enligt den delegerade förordningen (EU) 2017/575 har inte använts i analysen eftersom SIM bedömt att det saknas behov att nyttja relevant data.

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
Morgan Stanley Europe SE	28,78%	31,92%
54930056FHWP7GIWYY08		
Barclays Bank Ireland PLC	20,60%	19,75%
2G5BKIC2CB69PRJH1W31		
Macquarie Capital (Europe) Ltd	16,72%	21,55%
549300GX4FPMFF91RJ37		
ABG Sundal Collier ASA	11,75%	9,59%
2138005DRCU66B8BNY04		
Nordea Bank Abp	10,64%	8,01%
529900ODI3047E2LIV03		
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
Morgan Stanley Europe SE	29,17%	47,99%
54930056FHWP7GIWYY08		
ABG Sundal Collier ASA	19,55%	22,04%
2138005DRCU66B8BNY04		
Nordea Bank Abp	13,06%	8,96%
529900ODI3047E2LIV03		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	9,19%	4,92%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Carnegie Investment Bank AB	8,27%	2,91%
529900BR5NZNQZEVQ417		

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	31,02%	39,91%
549300GX4FPMFF91RJ37		
Barclays Bank Ireland PLC	27,02%	23,05%
2G5BKIC2CB69PRJH1W31		
Morgan Stanley Europe SE	26,99%	21,76%
54930056FHWP7GIWYY08		
Nordea Bank Abp	6,98%	4,19%
529900ODI3047E2LIV03		
Jefferies GmbH	2,25%	1,34%
5493004I3LZM39BWHQ75		
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	29,79%	21,87%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Nordea Bank Abp	20,41%	17,78%
529900ODI3047E2LIV03		
Swedbank AB	17,80%	15,48%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	17,59%	17,45%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Svenska Handelsbanken AB	11,32%	12,56%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		

[illegible]

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
Svenska Handelsbanken AB	65,34%	53,33%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Danske Bank A/S	21,35%	30,00%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Nordea Bank Abp	9,64%	10,00%
529900ODI3047E2LIV03		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2,76%	5,00%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Swedbank AB	0,92%	1,67%
M312WZV08Y7LYUC71685		
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
J.P. Morgan SE	49,96%	35,74%
549300BSB8CC9F02PN97		
Citigroup Global Markets Ltd	26,44%	21,25%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Danske Bank A/S	12,43%	18,44%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Societe Generale	4,34%	6,67%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2,06%	6,59%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		

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
Nordea Bank Abp	50,58%	53,19%
529900ODI3047E2LIV03		
Danske Bank A/S	23,81%	25,53%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	15,42%	10,64%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Swedbank AB	8,90%	8,51%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Svenska Handelsbanken AB	1,29%	2,13%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Klass av instrument	Valutaderivat	
	(ii) Swappar, forwardkontrakt och andra valutaderivat	
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
JP Morgan SE	19,29%	11,54%
549300BSB8CC9F02PN97		
Danske Bank A/S	19,14%	9,73%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	15,04%	52,09%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities SA	14,07%	5,22%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Citigroup Global Markets Europe AG	10,66%	5,27%
6TJCK1B7E7UTXP528Y04		

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
JP Morgan SE	47,13%	54,51%
549300BSB8CC9F02PN97		
BofA Securities Europe SA	19,66%	5,81%
549300FH0WJAPHTIQ77		
Citigroup Global Markets Europe AG	13,27%	18,68%
6TJCK1B7E7UTXP528Y04		
Societe Generale	8,66%	6,73%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
Danske Bank A/S	7,10%	9,70%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		

[illegible]