

Information om placering och utförande av order – 2019

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 för varje klass av finansiella instrument också 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.

Information i detta dokument avser kalenderåret 2019.

Analys om kvaliteten av utförandet av kundorder

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, börshandlande 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, börshandlande räntederivat och valutaderivat har SIM lagt störst vikt vid pris och kostnad för utförande av order och i andra hand sannolikheten för utförande.

För värdepappersfinansieringstransaktioner har SIM lagt störst vikt vid 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 och värdepappersföretag hos vilka SIM har placerat order. Under föregående år mottog

SIM inte några betalningar, rabatter eller icke-monetära förmåner av de handelsplatser eller värdepappersföretag som kundorder placerades hos.

Konsoliderad handelsinformation eller data enligt den delegerade förordningen (EU) 2017/575 har inte använts systematiskt i analysen. I syfte att uppnå bästa möjliga resultat i enlighet med bolagets policy om bästa möjliga resultat och orderhantering utvärderar SIM:s motpartscommitté regelbundet sin motpartpartslista ("motpartslistan") över vilka värdepappersbolag SIM kan placera order hos för varje klass av finansiella instrument. Under året har en motpart plockats bort från motpartslistan för handel med aktier samt en ny motpart tillkommit, efter överväganden av pris och kvalitet i orderutförandet. Vidare har en motpart för valuta adderats till motpartslistan. I detta fall som ett komplement till befintliga motparter, med möjlighet att ge konkurrenskraftiga priser, även på större volymer.

Information om de främsta handelsplatserna och värdepappersföretagen för utförande av kundorder

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.

Värdepappersföretag

Klass av instrument	Aktier - Aktier och depåbevis	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	(i) Tick-storlek - Likviditetsband 5 och 6	
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	22,49%	9,37%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities Europe SA	22,01%	27,19%
549300FHOWJAPEHTIQ77		
ABG Sundal Collier AB	14,34%	11,86%
549300FMOYCQNLVRRP95		
Carnegie Investment Bank AB	10,72%	2,49%
529900BR5NZNQZEVQ417		
Goldman Sachs International	5,74%	2,20%
W22LROWP2IHZNBB6K528		
Klass av instrument	Aktier - Aktier och depåbevis	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	(ii) Tick-storlek - Likviditetsband 3 och 4	
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 AB	20,60%	25,24%
549300FMOYCQNLVRRP95		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	19,21%	9,61%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Carnegie Investment Bank AB	18,94%	5,61%
529900BR5NZNQZEVQ417		
Nordea Bank Abp	10,98%	8,29%
529900ODI3047E2LIV03		
Morgan Stanley & Co. International PLC	10,86%	35,20%
4PQUHN3JPFGFNF3BB653		

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 Bank International Ltd	41,61%	45,43%
17GKQF40GFUEUWOO622		
BofA Securities Europe SA	36,18%	33,46%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Deutsche Bank AG	12,83%	12,81%
7LTWFZYICNSX8D621K86		
Morgan Stanley & Co. International PLC	3,26%	5,13%
4PQUHN3JPFQFN3BB653		
Nordea Bank Abp	2,01%	1,42%
529900ODI3047E2LIV03		
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
Nordea Bank Abp	32,46%	23,87%
529900ODI3047E2LIV03		
Danske Bank A/S	28,63%	33,60%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	24,58%	21,21%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Svenska Handelsbanken AB	7,22%	8,00%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Swedbank AB	5,89%	6,14%
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	81,75%	84,62%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Swedbank AB	10,95%	6,41%
M312WZV08Y7LYUC71685		
DNB Bank ASA	4,02%	5,13%
549300GKFG0RYRRQ1414		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2,56%	1,83%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Svenska Handelsbanken AB	1,46%	1,28%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
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	40,31%	33,68%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Danske Bank A/S	36,39%	29,52%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	9,79%	18,71%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Societe Generale	7,16%	3,12%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
Swedbank AB	2,83%	6,24%
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
Nordea Bank Abp	47,03%	39,34%
529900ODI3047E2LIV03		
Danske Bank A/S	22,33%	22,95%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	20,18%	26,23%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Swedbank AB	8,75%	6,56%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Svenska Handelsbanken AB	1,71%	4,92%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
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
Skandinaviska Enskilda Banken AB	29,29%	59,72%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Deutsche Bank AG	16,31%	4,22%
7LTWFZYICNSX8D621K86		
Danske Bank A/S	15,97%	9,54%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Nordea Bank Abp	14,43%	8,35%
529900ODI3047E2LIV03		
Goldman Sachs International	8,93%	3,76%
W22LROWP2IHZNB6K528		

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 Ltd	63,28%	55,11%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Danske Bank A/S	11,56%	26,37%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Swedbank AB	11,12%	15,44%
M312WZV08Y7LYUC71685		
BofA Securities Europe SA	10,53%	2,02%
549300FHOWJAPEHTIQ77		
Goldman Sachs International	3,38%	0,71%
W22LROWP2IHZNBB6K528		
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	85,23%	36,36%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities Europe SA	8,66%	36,36%
549300FHOWJAPEHTIQ77		
Goldman Sachs International	5,69%	22,73%
W22LROWP2IHZNBB6K528		
J.P. Morgan Securities PLC	0,41%	4,55%
K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32		

Klass av instrument	Råvaruderivat och utsläppsderivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	(i) Optioner och futures upptagna till handel på en handelsplats	
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	100,00%	100,00%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Klass av instrument	Råvaruderivat och utsläppsderivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	(ii) Övriga råvaruderivat och utsläppsderivat	
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
Goldman Sachs International	43,59%	26,32%
W22LROWP2IHZNB6K528		
J.P. Morgan Securities PLC	39,02%	47,37%
K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	16,47%	21,05%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities Europe SA	0,93%	5,26%
549300FHOWJAPEHTIQ77		

Värdepappersfinansieringstransaktioner (SFT)

Klass av instrument	Skuldinstrument SFT	
	(i) Obligationer SFT	
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	50,27%	52,58%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Nordea Bank Abp	24,20%	23,01%
529900ODI3047E2LIV03		
Swedbank AB	21,74%	19,94%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	3,79%	4,46%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		