

Skandia Sverige Exponering

Fonden investerar i svenska aktier och har hållbarhetsfokus. Investeringarna fördelas över olika branscher. Förvaltningen av fonden är indexnära och strävar efter att efterbilda sammansättningen av sitt skräddarsydda jämförelseindex, vilket utesluter bolag som utvinner eller genererar kraft från fossila bränslen, producerar vapen, tobak, cannabis eller kränker internationella normer. I tillägg premieras bolag som förvaltaren bedömer vara ledande inom sina branscher på att hantera relevanta hållbarhetsrisker och möjligheter.

En placering i den svenska aktiemarknaden har historiskt präglats av en något högre risknivå jämfört med en placering i en bred global aktieportfölj till följd av den begränsade geografiska inriktningen. Därför kan det förväntas att fonden även i fortsättningen kommer att uppvisa något högre risk än fonder som placerar i en global portfölj av utländska aktier. Placeringshorisonten för fondens andelsägare bör vara minst fem år. Åtagandemetoden används för att beräkna fondens sammanlagda exponering vilket innebär att eventuella derivatinstrument tas upp till den underliggande tillgångens exponering.

Skandia Sverige Exponering sjönk under perioden med 29,0 procent efter avgifter. Under samma period sjönk dess jämförelseindex med 29,6 procent.

Stockholmsbörsen inledde året med en nedgång på 9 procent under januari. Oron kring Rysslands invasion av Ukraina steg och beredskapen av NATO:s snabbinsatsstyrka förstärktes som följd. Omikronvarianten förde pandemin in i en ny fas vilket orsakade osäkerheter för handeln och estimerade svårigheter för Kinas ekonomi under året. Fortsatt ränteuppgång förstärkte det negativa sentimentet, och marknaden började prisa in en dubbelhöjning av räntan från Federal Reserve i mars.

Den negativa trenden på Stockholmsbörsen fortsatte även under februari med en nedgång på 7 procent. Marknadens växande oro för en rysk invasion orsakade fall på börserna och ett efterföljande ras när Putin i slutet av månaden meddelade en första militär insats mot Ukraina. Sanktionerna mot Ryssland trappades upp och EU beslutade bland annat att förbjuda transaktioner med Rysslands centralbank samt utesluta vissa ryska banker från Swift. Kina uppfattades ta ställning för Ryssland och beskyllde USA och NATO för krisen. Efter en tuff start på året steg Stockholmsbörsen med 2 procent under mars.

I april vände Stockholmsbörsen ned igen då den sjönk med 4 procent. Stora delar av marknadens fokus låg under månaden på den fortsatt ökade inflationen och räntehöjningarna där räntan i Sverige höjdes med 25 baspunkter till 0,25 procent. Ryssland stoppade delar av sin gasexport vilket resulterade i en initial prisökning på nära 20 procent. Europaterminerna gick ner och Asienbörserna föll brett på grund av oro kring det förvärrade pandemiläget i Kina.

Stockholmsbörsen sjönk ytterligare i maj under hög volatilitet liksom de globala marknaderna. Under juni sjönk Stockholmsbörsen med hela 11 procent. Fokus låg fortsatt på inflationshöjningarna, där bland annat inflationen i Sverige ökade med 7,2 procent. Riksbanken höjde som följd räntan med 50 baspunkter, vilket motsvarar den största räntehöjningen på 22 år.

Fonden har inte handlat med derivatinstrument under perioden.

Förvaltningsarvode

0,25 % per år

Exempel på ett sparandes nettovärde efter uttag av förvaltningsarvode och fördelade affärstransaktionskostnader.

| | Insatt belopp | Förvaltningskostnad | Nettovärde 2022-06-30 |
|--------------------------|---------------|---------------------|-----------------------|
| Engångsinsättning | | | |
| 2021-07-01 | 10 000 kr | 23 kr | 8 129 kr |
| Månadssparande | | | |
| 2021-07-01 - 2022-06-30 | 12 x 100 kr | 1 kr | 956 kr |

Årlig avgift:

0,25 %.

Ansvarig förvaltare:

Mattias Kellner (SIM).

Pensionsmyndigheten:

Fonden ingår i premiepensionsvalet.

Genomsnittlig avkastning

| Period | Fonden | Index | |
|----------------------------|-------------------------|--------|--------|
| Årsavkastning snitt (2 år) | 2020-07-01 - 2022-06-30 | 9,1 % | 8,8 % |
| Årsavkastning snitt (5 år) | 2017-07-01 - 2022-06-30 | 7,5 % | 7,8 % |
| Volatilitet snitt (2 år) | 2020-07-01 - 2022-06-30 | 20,1 % | 20,4 % |
| Tracking error (2 år) | 2020-07-01 - 2022-06-30 | 0,8 % | |

Jämförelseindex:

SIX Portfolio Return Index, ex Skandias exkluderar (inkluderar utdelningar).

10 års historik med Fondförmögenhet och Andelsvärde per 31 dec. samt Totalavkastning i % och fondens Utdelning per andel för respektive år. Utdelning per andel och Andelsvärde anges i kronor.

| År | Fondförmögenhet i tkr | Andelsvärde | Antal andelar i heftal | Utdelning per andel | Totalavkastning Fond | Totalavkastning Index |
|------|-----------------------|-------------|------------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|
| 2022 | 5 589 835 | 239,34 | 23 354 925 | 0,00 | -29,0 % | -29,6 % |
| 2021 | 7 678 842 | 337,02 | 22 784 635 | 0,00 | 39,6 % | 40,3 % |
| 2020 | 4 381 095 | 241,34 | 18 153 052 | 0,00 | 14,3 % | 14,8 % |
| 2019 | 4 103 763 | 211,22 | 19 428 531 | 0,00 | 34,3 % | 35,0 % |
| 2018 | 2 178 873 | 157,26 | 13 854 931 | 0,00 | -4,6 % | -4,2 % |
| 2017 | 2 234 556 | 164,82 | 13 557 152 | 0,00 | 9,4 % | 10,0 % |
| 2016 | 2 049 704 | 150,68 | 13 603 322 | 0,00 | 8,7 % | 9,2 % |
| 2015 | 2 351 776 | 138,59 | 16 969 305 | 0,00 | 5,5 % | 6,3 % |
| 2014 | 2 457 212 | 131,37 | 18 704 761 | 0,00 | 14,5 % | 15,0 % |
| 2013 | 1 889 901 | 114,78 | 16 465 421 | 0,00 | 14,8 % | 15,2 % |

Omsättningshastigheten i fonden

| År | ggr/år | Internt mellan egna fonder |
|------|--------|----------------------------|
| 2022 | 0,05 | 0,00 |

Fondens totala transaktionskostnader (inkl. courtage)

| År | Belopp, tkr | Del av omsättn., % |
|------|-------------|--------------------|
| 2022 | 195 | 0,02 |

BALANSRÄKNING

| Balansräkning, tkr | 2022 | 2021 |
|--|-------------|-------------|
| Tillgångar | | |
| Överlåtbara värdepapper | 5 575 629 | 5 997 860 |
| Penningmarknadsinstrument | 0 | 0 |
| OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Övriga derivatinstrument med positivt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Fondandelar | 0 | 0 |
| Summa fin. instrument med positivt marknadsvärde | 5 575 629 | 5 997 860 |
| Placering på konto hos kreditinstitut | 0 | 0 |
| Summa placeringar med positivt marknadsvärde | 5 575 629 | 5 997 860 |
| Bankmedel och övriga likvida medel | 18 414 | 11 349 |
| Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter | 0 | 0 |
| Övriga tillgångar (Not 2) | 6 067 | 52 440 |
| Summa tillgångar | 5 600 110 | 6 061 649 |
| Skulder | | |
| OTC-derivatinstrument med negativt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Övriga derivatinstrument med negativt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Övriga finansiella instrument med negativt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Summa fin. instrument med negativt marknadsvärde | 0 | 0 |
| Skatteskulder | 0 | 0 |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter | 1 215 | 1 236 |
| Övriga skulder (Not 2) | 9 060 | 20 828 |
| Summa skulder | 10 275 | 22 064 |
| Fondförmögenhet (Not 1) | 5 589 835 | 6 039 586 |
| Poster inom linjen | | |
| Utlånade finansiella instrument | 0 | 0 |
| Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument | 0 | 0 |
| Mottagna säkerheter för OTC-derivatinstrument | 0 | 0 |
| Mottagna säkerheter för övriga derivatinstrument | 0 | 0 |
| Övriga mottagna säkerheter | 0 | 0 |
| Ställda säkerheter för inlånade finansiella instrument | 0 | 0 |
| Ställda säkerheter för OTC-derivatinstrument | 0 | 0 |
| Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument | 0 | 0 |
| Övriga ställda säkerheter | 0 | 0 |
| NOTER | 2022 | 2021 |
| Not 1. Förändring av fondförmögenheten | | |
| Fondförmögenhet vid årets början | 7 678 842 | 4 381 095 |
| Andelsutgivning | 759 001 | 830 655 |
| Andelslösen | - 594 072 | - 174 667 |
| Årets resultat enligt resultaträkning | -2 253 936 | 1 002 504 |
| Inbetald upplupen utdelning vid andelsutgivning | 0 | 0 |
| Utbetald upplupen utdelning vid andelslösen | 0 | 0 |
| Lämnad utdelning | 0 | 0 |
| Fondförmögenhet vid årets slut | 5 589 835 | 6 039 586 |
| Not 2. Övriga tillgångar och skulder | | |
| I övriga tillgångar ingår olikviderade affärer | 6 067 | 52 440 |
| I övriga skulder ingår olikviderade affärer | - 9 060 | - 20 828 |

INNEHAV

| Finansiella instrument | Land* | Marknadsvärde, tkr | Del av fondförmögenhet | Del av fondförmögenhet per emittent |
|--|-------|--------------------|------------------------|-------------------------------------|
| Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES | | | | |
| Aktier | | | | |
| Dagligvaror | | | | |
| Axfood AB | SE | 30 100 | 0,54% | 0,54% |
| Midsona AB B | SE | 4 712 | 0,08% | 0,08% |
| Essity Aktiebolag B | SE | 136 183 | 2,44% | 2,44% |
| Summa Dagligvaror | | 170 995 | 3,06% | |
| Finans | | | | |
| Arion banki hf SDR | IS | 2 496 | 0,04% | 0,04% |
| Avanza Bank Holding AB | SE | 15 386 | 0,28% | 0,28% |
| Bure Equity AB | SE | 8 016 | 0,14% | 0,14% |
| Creades Ab | SE | 8 731 | 0,16% | 0,16% |
| EQT AB | SE | 140 984 | 2,52% | 2,52% |
| Svenska Handelsbanken AB A | SE | 116 628 | 2,09% | 2,09% |
| Industrivärden AB A | SE | 50 784 | 0,91% | 0,00% |
| Industrivärden AB C | SE | 5 927 | 0,11% | 1,01% |
| Investor A | SE | 337 | 0,01% | 0,00% |
| Investor B | SE | 356 684 | 6,38% | 6,39% |
| Kinnevik Ab B | SE | 31 840 | 0,57% | 0,57% |
| Linc AB | SE | 675 | 0,01% | 0,01% |
| L E Lundbergforetagen AB | SE | 57 888 | 1,04% | 1,04% |
| Nordnet AB | SE | 20 683 | 0,37% | 0,37% |
| Nordea Bank Abp | FI | 84 001 | 1,50% | 1,50% |
| Stockwik Forvaltning AB | SE | 691 | 0,01% | 0,01% |
| Investment Ab Oresund | SE | 6 299 | 0,11% | 0,11% |
| Qliro AB | SE | 526 | 0,01% | 0,01% |
| Resurs Holding AB | SE | 355 | 0,01% | 0,01% |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB A | SE | 151 026 | 2,70% | 2,70% |
| Solid Forsakring AB | SE | 330 | 0,01% | 0,01% |
| Svolder AB-B | SE | 7 608 | 0,14% | 0,14% |
| Swedbank AB A | SE | 88 194 | 1,58% | 1,58% |
| VEF AB | SE | 185 | 0,00% | 0,00% |
| Summa Finans | | 1 156 274 | 20,69% | |
| Hälsövärd | | | | |
| Active Biotech Ab | SE | 990 | 0,02% | 0,02% |
| Addlife AB | SE | 13 124 | 0,23% | 0,23% |
| Ambea Ab | SE | 7 378 | 0,13% | 0,13% |
| Arjo AB B | SE | 10 019 | 0,18% | 0,18% |
| Attendo | SE | 4 727 | 0,08% | 0,08% |
| AstraZeneca PLC | GB | 140 095 | 2,51% | 2,51% |
| Bactiguard Holding AB | SE | 3 778 | 0,07% | 0,07% |
| Bioinvent International AB | SE | 3 392 | 0,06% | 0,06% |
| Biogala B | SE | 8 987 | 0,16% | 0,16% |
| Biologie AB | SE | 11 101 | 0,20% | 0,20% |
| Boule Diagnostics AB | SE | 1 870 | 0,03% | 0,03% |
| Camurus AB | SE | 8 832 | 0,16% | 0,16% |
| Cellavision AB | SE | 8 392 | 0,15% | 0,15% |
| C-Rad AB | SE | 2 400 | 0,04% | 0,04% |
| Dedicare AB | SE | 2 035 | 0,04% | 0,04% |
| Elekta AB B | SE | 24 289 | 0,43% | 0,43% |
| Episurf Medical AB | SE | 1 063 | 0,02% | 0,02% |
| Gething B | SE | 43 031 | 0,77% | 0,77% |
| Hansa Biopharma AB | SE | 2 489 | 0,04% | 0,04% |
| Humana AB | SE | 4 503 | 0,08% | 0,08% |
| Irlab Therapeutics Ab | SE | 489 | 0,01% | 0,01% |
| Isofol Medical AB | SE | 172 | 0,00% | 0,00% |
| Karolinska Development AB | SE | 2 426 | 0,04% | 0,04% |
| Medicover AB | SE | 14 355 | 0,26% | 0,26% |
| Moberg Pharma Ab | SE | 470 | 0,01% | 0,01% |
| Medivir B | SE | 1 133 | 0,02% | 0,02% |
| Abilva AB | SE | 435 | 0,01% | 0,00% |
| Abilva AB BTA 2022 | SE | 150 | 0,00% | 0,01% |
| Medcap Ab | SE | 4 822 | 0,09% | 0,09% |
| NGS Group AB | SE | 152 | 0,00% | 0,00% |
| Vivesto AB | SE | 784 | 0,01% | 0,01% |
| Orexo AB | SE | 1 658 | 0,03% | 0,03% |
| Probi AB | SE | 2 367 | 0,04% | 0,04% |
| Q-Linea Ab | SE | 587 | 0,01% | 0,01% |
| Raysearch Laboratories B | SE | 3 566 | 0,06% | 0,06% |
| Sectra B | SE | 18 208 | 0,33% | 0,33% |
| Swedish Orphan Biovitrum AB | SE | 45 620 | 0,82% | 0,82% |
| Vitrolife AB | SE | 18 909 | 0,34% | 0,34% |
| Elos Medtech Ab | SE | 3 418 | 0,06% | 0,06% |
| Summa Hälsövärd | | 422 115 | 7,55% | |
| Industri | | | | |
| ABB Ltd | CH | 104 915 | 1,88% | 1,88% |
| Alfa Laval AB | SE | 82 545 | 1,48% | 1,48% |
| Assa Abloy B | SE | 164 550 | 2,94% | 2,94% |
| Addtech B | SE | 23 048 | 0,41% | 0,41% |
| Atlas Copco A | SE | 16 089 | 0,29% | 0,00% |
| Atlas Copco B | SE | 313 431 | 5,61% | 5,89% |
| BE Group AB | SE | 1 750 | 0,03% | 0,03% |
| Beijer Ref AB B | SE | 39 831 | 0,71% | 0,71% |
| Bergman and Beving AB | SE | 3 405 | 0,06% | 0,06% |
| Bong Ab | SE | 595 | 0,01% | 0,01% |
| Bravida Holding AB | SE | 7 464 | 0,13% | 0,13% |
| Bts Group B | SE | 5 818 | 0,10% | 0,10% |
| Coor Service Management Holding Ab | SE | 10 656 | 0,19% | 0,19% |
| CITEK AB | SE | 2 105 | 0,04% | 0,04% |
| Elanders B | SE | 4 165 | 0,07% | 0,07% |
| Electrolux Professional AB B | SE | 20 953 | 0,37% | 0,37% |
| Eolus Vind Ab B | SE | 3 639 | 0,07% | 0,07% |
| Epiroc AB A | SE | 13 529 | 0,24% | 0,00% |
| Epiroc AB B | SE | 120 409 | 2,15% | 2,40% |
| Lammhults Design Group AB | SE | 1 014 | 0,02% | 0,02% |
| Fagerhult AB | SE | 8 887 | 0,16% | 0,16% |
| Garö AB | SE | 5 863 | 0,10% | 0,10% |
| Green Landscaping Group AB | SE | 2 429 | 0,04% | 0,04% |
| Husqvarna B | SE | 31 091 | 0,56% | 0,56% |
| Indutrade AB | SE | 42 547 | 0,76% | 0,76% |
| Instalco Ab | SE | 6 176 | 0,11% | 0,11% |
| Intrum Ab | SE | 13 076 | 0,23% | 0,23% |
| ITAB Shop Concept B | SE | 699 | 0,01% | 0,01% |
| Investment Ab Latour B | SE | 81 499 | 1,46% | 1,46% |
| Lifco AB - B | SE | 47 074 | 0,84% | 0,84% |
| Lindab International AB | SE | 5 941 | 0,11% | 0,11% |
| Loomis AB | SE | 10 201 | 0,18% | 0,18% |

