

Skandia Mix 30 Exponering

Fonden är en indexnära fondandelsfond som ger exponering mot svenska obligationer samt svenska och utländska aktier. Fonden saknar fast fördelning mellan tillgångsslagen, men har som mål att hålla cirka 30 procent av tillgångarna exponerat mot aktier. Aktieexponeringen har en bred inriktning mot olika länder, branscher och valutor. Fonden är fossilfri, har hållbarhetsfokus och investerar företrädesvis i verksamheter eller organisationer som arbetar för miljö och samhälle, både på kort och på lång sikt. Fonden strävar efter att ha minst 50 procent av tillgångarna exponerat mot verksamheter eller organisationer som bidrar till en hållbar utveckling. Derivatinstrument får användas för att minska kostnader och risker i förvaltningen. Fondens mål är att följa avkastningen på sitt jämförelseindex, före avdrag för avgifter.

En placering i en portfölj med övervägande svenska räntebärande värdepapper och en mindre del i svenska och globala aktier har historiskt uppvisat en risknivå som ligger högre än en svensk räntefond, men under risknivån för en placering i en svensk/global aktiefond. Det är därför troligt att fonden även i fortsättningen kommer att uppvisa en sådan risknivå. Fondens investeringar i utländska aktier valutasäkras inte, vilket får till följd att fonden påverkas av förändringar i växelkurser för de valutor som fonden investerar i. Derivatinstrument får användas för att minska kostnader och risker i förvaltningen. Placeringshorisonten för fondens andelsägare bör vara minst två till tre år. Åtagandemetoden används för att beräkna fondens sammanlagda exponering vilket innebär att eventuella derivatinstrument tas upp till den underliggande tillgångens exponering.

Skandia Mix 30 Exponering sjönk 10,9 procent under första halvåret 2022. Under samma period sjönk jämförelseindex 10,9 procent.

Årets första halvår har varit minst sagt utmanade för investeringar i såväl aktier som obligationer samt krediter. Den svenska börsen (mätt som SIX Portfolio Return inkl. Skandias exkluderingar) föll hela 30% medan globala aktieinvesteringar (mätt som MSCI World inkl. Skandias exkluderingar) föll nära 13% i svenska kronor räknat. Svenska obligationer (mätt som OMRX Bond All) tappade 7% och diversifieringen mellan traditionella tillgångsslag lyste med sin frånvaro precis när den behövdes som mest. En anledning till den synkroniserade nedgången för många finansiella tillgångar är den överraskande höga inflationen. Att den generella prisuppgången på varor och tjänster i både USA, Europa och i Sverige är den högsta på många decennier gör att centralbankerna nu måste leverera snabba räntehöjningar och strama åt likviditeten ordentligt. Att få bukt med inflationen utan att knäcka tillväxten är en svår uppgift och nervositeten hos världens investerare har ökat samtidigt som riskviljan minskat markant. Få tillgångsslag gick mot strömmen under denna period men råvaror och den amerikanska dollarn är två exempel på det. Vissa råvarupriser trycktes givetvis upp i kölvattnet av den mycket tragiska utvecklingen med storskaligt krig i Europa då Ryssland invaderade Ukraina. Osäkerhet kring hur aggressivt centralbankerna måste gå fram för att den höga inflationen inte ska bita sig fast är stor och hur hårt vårens kraftiga ränteuppgång slår mot konsumenten, företagen och konjunkturen är också oviss.

Under denna period var det fondens svenska aktieexponering som gav sämst avkastning men fondens portfölj klarade sig dock något bättre än jämförelseindex. Den globala aktieportföljen visar inte samma branta nedgång som den svenska, vilket till stor del beror på grund av svag utveckling för den svenska kronan mot både dollarn och euron vilket bromsar nedgången för utländska aktieinvesteringar. Även den globala aktieportföljen visar positiv relativ avkastning jämfört med sitt index för perioden. Den direktinvesterade ränteportföljen föll nära 7%, vilket också var något bättre jämfört med fondens ränteindex. Arbetet med integrering av hållbarhet fortsätter och bolagens hållbarhetseffekter ställs löpande mot deras övriga egenskaper,

varför bolag löpande introduceras respektive avyttras från fonden baserat på hållbarhetskriterier.

Fonden har inte handlat med derivatinstrument under perioden.

Förvaltningsarvode
0,45 % per år

Årlig avgift
0,45 %

Ansvarig förvaltare
Maria Qundos (SIM)

Pensionsmyndigheten
Fonden ingår ej premiepensionsvalet

Jämförelseindex
12 % SIX Portfolio Return Index, ex Skandias exkluderingar, 18 % MSCI World ex client defined securities index & 70 % OMRX Bond All Index

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	473 838	93,42	5 072 160	0,00	-10,9 %	-10,9 %
2021	415 579	104,90	3 961 802	0,00	5,1 %	5,5 %

*Fondförmögenhet och andelsvärde ovan är beräknade med slutkurser per 30 juni på fondens placeringar.

Omsättningshastigheten i fonden

År	ggr/år	Internt mellan egna fonder
2022	0,19	0,00

Fondens totala transaktionskostnader (inkl. courtage)

År	Belopp, tkr	Del av omsätt., %
2022	0	0,00

BALANSRÄKNING

Balansräkning, tkr	2022	2021
Tillgångar		
Överlåtbara värdepapper	324 180	128 660
Penningmarknadsinstrument	0	0
OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde	0	0
Övriga derivatinstrument med positivt marknadsvärde	0	0
Fondandelar	142 233	60 929
Summa fin. instrument med positivt marknadsvärde	466 412	189 589
Placering på konto hos kreditinstitut	0	0
Summa placeringar med positivt marknadsvärde	466 412	189 589
Bankmedel och övriga likvida medel	6 104	14 207
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	1 408	383
Övriga tillgångar (Not 2)	88	27
Summa tillgångar	474 013	204 206
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	175	70
Övriga skulder (Not 2)	0	1 990
Summa skulder	175	2 060
Fondförmögenhet (Not 1)	473 838	202 146
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	415 579	0
Andelsutgivning	272 221	203 657
Andelslösen	- 161 316	- 3 558
Årets resultat enligt resultaträkning	- 52 646	2 047
Inbetald upplupen utdelning vid andelsutgivning	0	0
Utbetald upplupen utdelning vid andelslösen	0	0
Lämnad utdelning	0	0
Fondförmögenhet vid årets slut	473 838	202 146
Not 2. Övriga tillgångar och skulder		
I övriga tillgångar ingår olivkviderade affärer	0	0
I övriga skulder ingår olivkviderade affärer	0	- 1 990

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				
Räntebärande värdepapper				
Företag och Kreditinstitut				
African Development Bank 0.2425 14.04.2023	SNA	5 937	1,25%	1,25%
Asian Development Bank 0.295 08.07.2026	PH	3 622	0,76%	0,00%
Asian Development Bank 0.37 26.06.2023	PH	3 941	0,83%	1,60%
Fastighets AB Balder (publ) FRN 06.02.2023	SE	3 945	0,83%	0,83%
Castellum AB FRN 22.12.2022	SE	3 983	0,84%	0,84%
Dnb Bank ASA 1.3775 24.03.2025	NO	1 938	0,41%	0,41%
Electrolux AB 1.705 24.02.2027	SE	1 804	0,38%	0,38%
Ellevio AB 1.728 11.06.2027	SE	3 539	0,75%	0,75%
European Investment Bank 0.25 23.03.2026	LU	3 649	0,77%	0,00%
European Investment Bank 0.375 17.09.2030	LU	3 641	0,77%	1,54%
Eurofima 0.2125 03.12.2025	LU	1 830	0,39%	0,00%
Eurofima 0.49 27.11.2028	LU	1 696	0,36%	0,74%
Göteborgs Stad 1 05.11.2024	SE	4 801	1,01%	0,00%
Intl Bank for Recon and Devel 0.25 29.01.2029	SNA	3 345	0,71%	0,00%
Intl Bank for Recon and Devel 0.625 05.09.2025	SNA	1 873	0,40%	1,10%
International Develop. Association 0.25 25.06.2	SNA	4 635	0,98%	0,98%
Intl Finance Corp 0.9 12.05.2025	SNA	1 901	0,40%	0,40%
Jernhusen AB 1.368 23.04.2025	SE	1 883	0,40%	0,40%
Kfw 0.25 09.09.2026	DE	8 082	1,71%	0,00%
KfW 1.375 02.02.2028	DE	1 849	0,39%	2,10%
Kommunalbanken AS 0.125 28.08.2026	NO	8 904	1,88%	1,88%
Kommuninvest i Sverige AB 0.25 26.11.2027	SE	1 722	0,36%	0,00%
Kommuninvest i Sverige AB 0.375 27.03.2024	SE	3 868	0,82%	0,00%
Kommuninvest i Sverige AB 1 02.10.2024	SE	1 933	0,41%	0,00%
Malmö kommun 0.75 07.12.2023	SE	3 916	0,83%	0,00%
Malmö kommun 0.875 17.09.2024	SE	9 622	2,03%	2,86%
Neder Waterschapsbank 0.7 25.01.2023	NL	4 981	1,05%	1,05%
Nordic Investment Bank 0.1 13.10.2025	FI	1 834	0,39%	0,00%
Nordic Investment Bank 0.448 29.08.2022	FI	2 999	0,63%	1,02%
Östersunds kommun FRN 23.06.2025	SE	4 054	0,86%	0,86%
SBAB Bank AB (Publ) 0.315 18.01.2024	SE	1 921	0,41%	0,41%
Swedish Export Credit 0.215 15.09.2025	SE	4 574	0,97%	0,00%
Swedish Export Credit 0.25 26.06.2025	SE	1 845	0,39%	0,00%
Swedish Export Credit 0.41 14.09.2026	SE	1 783	0,38%	1,73%
Vasakronan AB FRN 24.04.2025	SE	3 958	0,84%	0,00%
Vasakronan AB (publ) 0.64 02.09.2025	SE	5 427	1,15%	0,00%
Vasakronan AB 2.238 06.05.2024	SE	2 936	0,62%	2,60%
DNB Boligkreditt AS 0.75 31.01.2024	NO	2 919	0,62%	0,62%
Lansförsäkringar Hypotek 1.5 16.09.2026	SE	7 492	1,58%	0,00%
Lansförsäkringar Hypotek AB 0.5 20.09.2028	SE	7 585	1,60%	0,00%
Lansförsäkringar Hypotek AB (publ) 1.5 18.09.24	SE	4 873	1,03%	4,21%
Lanshypotek Bank AB 0.615 18.11.2025	SE	1 843	0,39%	0,39%
Nordea Hypotek AB 1 18.03.2024	SE	9 640	2,03%	2,03%
Realkredit Danmark A/S FRN 01.10.2024	DK	2 009	0,42%	0,42%
AB Sveriges Säkerställda Obligationer (publ) SCB	SE	3 463	0,73%	0,00%
Swedish Covered Bond Corp 0.75 28.03.2024	SE	3 878	0,82%	0,00%
Swedish Covered Bond Corp 1 12.06.2024	SE	13 591	2,87%	0,00%
Swedish Covered Bond 1 12.06.2030	SE	1 663	0,35%	4,77%
Skandinaviska Enskilda Banken AB 16.12.2026	SE	5 339	1,13%	0,00%
Skandinaviska Enskilda Banken AB 1 19.12.2029	SE	1 685	0,36%	0,00%
Skandinaviska Enskilda 1 17.12.2025	SE	1 868	0,39%	0,00%
Skandinaviska Enskilda 1 18.12.2024	SE	3 834	0,81%	2,69%
Stadshypotek AB (publ) 1 03.09.2025	SE	9 415	1,99%	0,00%
Stadshypotek AB 1 01.03.2027	SE	1 813	0,38%	0,00%
Stadshypotek AB 1588 1.5 01.03.2024	SE	1 971	0,42%	0,00%
Stadshypotek AB 1594 2 01.09.2028	SE	9 280	1,96%	4,74%
Swedbank AB (publ) 1 29.03.2023	SE	5 947	1,26%	0,00%
Swedbank Hypotek AB 1 17.03.2027	SE	9 049	1,91%	0,00%
Swedbank Hypotek AB 1 18.06.2025	SE	2 839	0,60%	0,00%
Swedbank Hypotek AB 1 18.09.2024	SE	18 318	3,87%	7,63%
Summa Företag och Kreditinstitut		264 482	55,82%	
Stat och Kommun				
City Of Gothenburg 0.455 27.11.2025	SE	1 837	0,39%	1,40%
Jönköpings Kommun 0.57 01.12.2025	SE	3 685	0,78%	0,78%
Kommuninvest i Sverige 0.875 16.05.2029	SE	3 443	0,73%	2,31%
Region Stockholm 0.893 28.04.2031	SE	1 610	0,34%	0,34%
Kingdom of Sweden 0.125 09.09.2030	SE	7 906	1,67%	0,00%
SO 1053 3.50% 2039/03/30	SE	6 248	1,32%	0,00%
SO 1056 2.25% 2032/06/01	SE	8 405	1,77%	0,00%
SO 1057 1.5% 2023/11/13	SE	3 993	0,84%	0,00%
SO 1058 2.5 12.05.2025	SE	7 118	1,50%	0,00%
SO 1059 1 12.11.2026	SE	5 796	1,22%	0,00%
SO 1060 0.75 12.05.2028	SE	1 885	0,40%	0,00%
Sverige Kongeriket 0.125 12.05.2031	SE	1 739	0,37%	0,00%
Sverige Kongeriket 0.5 24.11.2045	SE	3 018	0,64%	0,00%
Sverige Kongeriket 0.75 12.11.2029	SE	2 325	0,49%	0,00%
Sverige Kongeriket 1.375 23.06.2071	SE	691	0,15%	10,37%
Summa Stat och Kommun		59 698	12,60%	
Summa Räntebärande värdepapper		324 180	68,42%	
Summa Överlåtbara värdepapper		324 180	68,42%	
ÖVRIGA FINANSIELLA INSTRUMENT				
Fondandelar				
Aktie- och blandfonder				
Skandia Global Exponering	SE	85 593	18,06%	18,06%
Skandia Sverige Exponering	SE	56 640	11,95%	11,95%
Summa Aktie- och blandfonder		142 233	30,02%	
Summa Fondandelar		142 233	30,02%	
Summa Övriga finansiella instrument		142 233	30,02%	
Summa Finansiella instrument				
Med positivt marknadsvärde		466 412	98,43%	0,00%
Med negativt marknadsvärde		0	0,00%	0,00%
Övriga tillgångar och skulder		7 425	1,57%	0,00%
Varav likvida medel SEB		6 104	1,29%	0,00%
Fondförmögenhet		473 838	100,00%	
Specifikation exponering enskilda företagsgrupper				
SEB				
Bankmedel SEB		6 104	1,29%	0,00%
Skandinaviska Enskilda Banken AB 16.12.2026		5 339	1,13%	0,00%

Skandinaviska Enskilda Banken AB 1 19.12.2029	1 685	0,36%	0,00%
Skandinaviska Enskilda 1 17.12.2025	1 868	0,39%	0,00%
Skandinaviska Enskilda 1 18.12.2024	3 834	0,81%	0,00%
Summa SEB	18 831	3,97%	
Derivatexponering			
Totalt utställda derivat	0	0,00%	0,00%
Totalt innehavda derivat	0	0,00%	0,00%
Netto valutaterminer (OTC)	0	0,00%	0,00%
Summa derivatexponering	0	0,00%	
Total fördelning av tillgångar och skulder			
Aktierelaterade finansiella instrument	142 233	30,02%	0,00%
Ränterelaterade finansiella instrument	324 180	68,42%	0,00%
Övrigt	7 425	1,57%	0,00%
Summa tillgångar och skulder	473 838	100,00%	

* Avser det land där det finansiella instrumentet är noterat. Specifikation av landskoder återfinns i slutet av rapporten.

I innehavstabellerna är siffrorna avrundade till närmaste tusental respektive andra decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge ett resultat som avviker från den angivna slutsumman. De marknadsbedömningar, analyser strategier som presenteras i rapporten är de som gäller i juni 2022. Vi gör dock löpande bedömningar av marknaderna. Om förutsättningarna blir annorlunda kan våra bedömningar, analyser och strategier därför komma att förändras.