

Information om placering och utförande av order – 2020

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 2020.

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, 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 värdepappersföretag hos vilka SIM har placerat order. Under föregående år mottog SIM inte några betalningar, rabatter eller icke-monetära förmåner av de värdepappersföretag som kundorder placerades hos.

Konsoliderad handelsinformation eller data enligt den delegerade förordningen (EU) 2017/575 har inte använts i analysen. 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 åtta motparter tillkommit på motpartslistan för handel med företagsobligationer, efter överväganden av pris och kvalitet i orderutförandet. Vidare har en motpart för swappar adderats till motpartslistan. I detta fall som ett komplement till befintliga motparter, med möjlighet att ge konkurrenskraftiga priser, även på större volymer. Slutligen så har en motpart plockats bort från motpartslistan för handel med aktiederivat på grund av låga handelsvolymer.

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 AB	23,26%	12,40%
549300FMOYCQNLVRRP95		
BofA Securities Europe SA	20,82%	27,56%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Nordea Bank Abp	14,27%	15,44%
529900ODI3047E2LIV03		
Macquarie Bank International Ltd	10,11%	20,35%
17GKQF40GFUEUWOO622		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	8,19%	2,86%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		

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 AB	27,22%	27,99%
549300FMOYCQNLVRRP95		
Nordea Bank Abp	17,25%	19,37%
529900ODI3047E2LIV03		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	14,51%	5,75%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Carnegie Investment Bank AB	9,35%	3,69%
529900BR5NZNQZEVQ417		
Morgan Stanley & Co. International PLC	7,94%	19,69%
4PQUHN3JPFGNF3BB653		
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
BofA Securities Europe SA	38,17%	37,57%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Macquarie Bank International Ltd	33,09%	40,60%
17GKQF40GFUEUWOO622		
Nordea Bank Abp	13,91%	11,97%
529900ODI3047E2LIV03		
Morgan Stanley & Co. International PLC	6,77%	6,51%
4PQUHN3JPFGNF3BB653		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2,89%	0,64%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		

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
Skandinaviska Enskilda Banken AB F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86	34,35%	29,88%
Danske Bank A/S MAES062Z21O4RZ2U7M96	32,37%	31,64%
Nordea Bank Abp 529900ODI3047E2LIV03	12,46%	10,37%
Svenska Handelsbanken AB NHBDILHZTYCNBV5UYZ31	10,99%	13,48%
Swedbank AB M312WZV08Y7LYUC71685	8,99%	12,06%
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 MAES062Z21O4RZ2U7M96	60,68%	60,54%
Swedbank AB M312WZV08Y7LYUC71685	26,57%	25,10%
Skandinaviska Enskilda Banken AB F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86	9,75%	11,21%
Nordea Bank Abp 529900ODI3047E2LIV03	3,00%	3,16%

Klass av instrument	Skuldinstrument	
	(i) Obligationer	
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%
BTFE		
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	60,64%	50,46%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Svenska Handelsbanken AB	12,95%	13,76%
NHBDILHZTYCNBV5UYZ31		
Swedbank AB	11,94%	12,84%
M312WZV08Y7LYUC71685		
DNB ASA	8,81%	14,68%
5967007LIEEXZ78M803		
Nordea Bank Abp	2,88%	5,50%
529900ODI3047E2LIV03		

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	43,66%	33,23%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Danske Bank A/S	25,94%	25,20%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Societe Generale	13,50%	5,98%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
Skandinaviska Enskilda Banken AB	7,35%	18,58%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
Nordea Bank Abp	3,23%	5,67%
529900ODI3047E2LIV03		
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	Aktiederivat	
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
Danske Bank A/S	38,57%	51,18%
MAES062Z21O4RZ2U7M96		
Citigroup Global Markets Ltd	33,57%	35,76%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
BofA Securities Europe SA	11,02%	3,76%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Swedbank AB	7,96%	8,00%
M312WZV08Y7LYUC71685		
Goldman Sachs International	7,06%	0,94%
W22LROWP2IHZNBB6K528		
Klass av instrument	Aktiederivat	
Anmälan om i genomsnitt < 1 handelstransaktion per handelsdag under föregående år	(ii) Swappar och andra aktiederivat	
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	71,66%	42,11%
F3JS33DEI6XQ4ZBPTN86		
BofA Securities Europe SA	24,88%	31,58%
549300FH0WJAPEHTIQ77		
Goldman Sachs International	1,73%	10,53%
W22LROWP2IHZNBB6K528		
J.P. Morgan Securities PLC	1,73%	15,79%
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	99,87%	99,89%
XKZZ2JZF41MRHTR1V493		
Societe Generale	0,13%	0,11%
O2RNE8IBXP4R0TD8PU41		
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
J.P. Morgan Securities PLC	95,26%	83,33%
K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32		
Barclays Bank PLC	2,71%	11,11%
G5GSEF7VJP5I7OUK5573		
BofA Securities Europe SA	2,03%	5,56%
549300FHOWJAPEHTIQ77		

