

Norden Index Criteria

Förvaltningsberättelse

Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet SIX SRI Nordic Index NI så nära som möjligt. Fonden placerar i aktier enligt detta index. Indexet består av samtliga bolag på Stockholmsbörsen, Oslo Börs, Köpenhamnsbörsen samt Helsingforsbörsen exklusive de bolag som inte uppfyller hållbarhetskraven. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Bolag som inte uppfyller definierade krav avseende hållbarhet får inte ingå i index. Hållbarhetskraven innefattar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och ägarstyrning. Kraven innefattar även en restriktiv hållning till bolag med verksamhet inom fossila bränslen och kontroversiella branscher såsom krigsmateriel, tobak, alkohol, spel och pornografi. För mer utförlig information hänvisas till fondens hållbarhetsprofil och även fondens informationsbroschyr.

Portföljen

Norden Index Criteria steg med 1,0% under perioden 20 september – 31 december 2017*. Portföljen utgörs av ett urval av de aktier som ingår i SIX SRI Nordic Index. Under året har flera aktier tillkommit eller utgått ur index, som vid årsskiftet bestod av drygt 650 aktier. De största innehaven i fonden är Novo Nordisk, Atlas Copco och Nordea. De största sektorerna i fonden är industrivaror och -tjänster, finans och fastighet samt hälsovård.

*) Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

Väsentliga risker

Per balansdagen har fonden i sina innehav inga andra väsentliga risker än de som framgår av faktabladet och informationsbroschyren.

Handel med derivatinstrument m.m.

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i

fondens placeringsinriktning. Under 2017 har fonden utnyttjat denna möjlighet i liten omfattning. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2017 har fonden utnyttjat denna möjlighet i liten omfattning. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument (vad som avses med tekniker och instrument, se bilaga Definitioner årsberättelse). Under 2017 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Information

Fonden startades 20 september 2017.

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis inom EU på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

Information om ersättning till anställda återfinns i bilaga Ersättningspolicy, se fondbolagets hemsida i anslutning till fonden samt även i slutet av den samlade fonddrapporten.

Fondens utveckling*



* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

Fondfakta - historik

| | 20/9-31/12 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 |
|--|--------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Andelsvärde | | | | | | | | | | |
| Norden Index Criteria A1 - SEK | 101,04 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - EUR | 10,28 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | 100,94 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Fondens totala nettoflöde, mnSEK | 1 169 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Fondförmögenhet totalt, mnSEK | | | | | | | | | | |
| Norden Index Criteria A1 - SEK | 1 165 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - EUR | 0 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | 4 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Antal andelar totalt, tusental | | | | | | | | | | |
| Norden Index Criteria A1 - SEK | 11 527 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - EUR | 11 483 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | 3 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | 41 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Total avkastning i % | | | | | | | | | | |
| Norden Index Criteria A1 - SEK | +1,0 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - EUR | -2,0 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | +2,9 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Jämförelseindex inklusive utdelning i % | | | | | | | | | | |
| Norden Index Criteria A1 - SEK | +1,3 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - EUR | -1,8 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Norden Index Criteria A1 - NOK | +3,1 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Omräkningskurs EUR/SEK | 9,83 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Omräkningskurs NOK/SEK | 1,00 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

Jämförelseindex: SIX SRI Nordic Index NI

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

Fondfakta - kostnader

| | |
|--|------|
| Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser | 0,60 |
| Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet | 0,40 |
| Årlig avgift, % | 0,41 |
| Analyskostnader, tSEK | - |
| Transaktionskostnader, tSEK | 257 |
| Transaktionskostnader i % av omsättningen | 0,02 |
| Förvaltningskostnad i SEK vid engångsinsättning 10 000 SEK | - |
| Förvaltningskostnad i SEK vid månadssparande 100 SEK | - |

Fondfakta - övriga nyckeltal

| | |
|---|------|
| Omsättningshastighet, ggr | 0,3 |
| Andel av oms. som skett genom närstående värdepappersinstitut, % | 31,1 |
| Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Xact Kapitalförvaltning AB, % | 0,0 |

Risk- och avkastningsmått*

| | |
|---|-----|
| Prognostiserad total risk | 8,2 |
| * Fonden har funnits i mindre än två år och beräkning av historisk risk är inte tillämpligt. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten. | |
| De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden. | |

Resultaträkning, tSEK

| | 2017 | 2016 |
|---|---------------|------|
| INTÄKTER OCH VÄRDEFÖRÄNDRING | | |
| Värdeförändring på överlåtbara värdepapper* | -6 284 | - |
| Värdeförändring på övriga derivatinstrument** | -52 | - |
| Värdeförändring på fondandelar*** | 62 | - |
| Ränteutgifter | 0 | - |
| Utdelningar | 2 448 | - |
| Valutakursvinster och -förluster netto | 423 | - |
| Övriga finansiella intäkter ¹⁾ | 74 | - |
| Övriga intäkter | 24 | - |
| Summa intäkter och värdeförändring | -3 305 | |
| KOSTNADER | | |
| Förvaltningskostnader: | | |
| - Ersättning till fondbolaget | 906 | - |
| Räntekostnader | 2 | - |
| Övriga finansiella kostnader | 15 | - |
| Övriga kostnader | 258 | - |
| Summa kostnader | 1 181 | |
| Årets resultat | -4 486 | |
| * Specifikation av värdeförändring | | |
| Realisationsvinster | 642 | |
| Realisationsförluster | -614 | |
| Orealiserade vinster/förluster | -6 312 | |
| Summa | -6 284 | |
| ** Specifikation av värdeförändring | | |
| Realisationsvinster | 30 | |
| Realisationsförluster | -82 | |
| Summa | -52 | |
| *** Specifikation av värdeförändring | | |
| Realisationsvinster | 290 | |
| Realisationsförluster | -130 | |
| Orealiserade vinster/förluster | -98 | |
| Summa | 62 | |

1) Posten består huvudsakligen av premier för utlånade värdepapper.

Balansräkning, tSEK

| | 31 dec 2017 | % av fondförm. | 31 dec 2016 | % av fondförm. |
|---|------------------|----------------|-------------|----------------|
| TILLGÅNGAR | | | | |
| Överlåtbara värdepapper | 1 149 082 | 98,7 | | |
| Fondandelar | 15 031 | 1,3 | | |
| Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde Not 2) | 1 164 113 | 100,0 | | |
| Bankmedel och övriga likvida medel | 6 212 | 0,5 | | |
| Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter | 52 | 0,0 | | |
| Övriga tillgångar | 815 | 0,1 | | |
| Summa tillgångar | 1 171 192 | 100,6 | | |
| SKULDER | | | | |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter | 226 | 0,0 | | |
| Övriga skulder | 6 261 | 0,6 | | |
| Summa skulder | 6 487 | 0,6 | | |
| Fondförmögenhet Not 1) | 1 164 705 | 100,0 | | |
| Utlånade finansiella instrument | 62 119 | 5,3 | | |
| Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument | 67 035 | 5,8 | | |

Not 1) till balansräkning

Förändring av fondförmögenhet, tSEK

| | 2017 | 2016 |
|---|------------------|------|
| Fondförmögenhet vid periodens början | - | - |
| Andelsutgivning | 1 172 421 | - |
| Andelsinlösen | -3 230 | - |
| Resultat enligt resultaträkning | -4 486 | - |
| Utdelning till andelsägarna | - | - |
| Fondförmögenhet vid periodens slut | 1 164 705 | |

Not 2) till balansräkning

Fondens innehav av finansiella instrument

ÖVERLÅTBARA VÄRDEPAPPER*

| | Antal/Nom. bel. tusental | Marknadsvärde tSEK | % av fondförm. |
|--|--------------------------|--------------------|----------------|
| NOTERADE AKTIER | | | |
| DAGLIGVAROR | | | |
| AarhusKarlshamn (Livsmedel) | 3 898 | 2 738 | 0,2 |
| Atria Group (Livsmedel) | 2 992 | 356 | 0,0 |
| Austevoll Seafood (Livsmedel) | 17 943 | 1 226 | 0,1 |
| Axfood (Livsmedels- och läkemedelsdetaljhandel) | 19 634 | 3 104 | 0,3 |
| Cloetta B (Livsmedel) | 26 037 | 773 | 0,1 |
| Duni (Kosmetika och hygienprodukter) | 4 937 | 599 | 0,1 |
| Essity B (Hushållsprodukter) | 63 174 | 14 720 | 1,3 |
| Grieg Seafood (Livsmedel) | 10 008 | 724 | 0,1 |
| HKScan Oyj A (Livsmedel) | 7 411 | 228 | 0,0 |
| ICA Gruppen (Livsmedel) | 18 297 | 5 451 | 0,5 |
| Kesko B (Livsmedels- och läkemedelsdetaljhandel) | 9 247 | 4 114 | 0,4 |
| Lerøy Seafood Group (Livsmedel) | 53 071 | 2 336 | 0,2 |
| Marine Harvest (Livsmedel) | 44 056 | 6 130 | 0,5 |
| Matas (Kosmetika och hygienprodukter) | 3 305 | 343 | 0,0 |
| Norway Royal Salmon (Livsmedel) | 3 580 | 482 | 0,0 |
| Orflame Holding (Kosmetika och hygienprodukter) | 4 814 | 1 629 | 0,1 |
| Raisio (Hushållsprodukter) | 16 380 | 618 | 0,1 |
| SailMar (Livsmedel) | 10 131 | 2 503 | 0,2 |
| Scandi Standard (Livsmedel) | 6 113 | 388 | 0,0 |
| Scottish Salmon Co Ltd (Livsmedel) | 14 572 | 117 | 0,0 |
| Suominen (Hushållsprodukter) | 5 714 | 248 | 0,0 |
| | | 48 826 | 4,2 |
| ENERGI | | | |
| Swedol B (Energiutrustningsutrustning och tjänster) | 8 027 | 234 | 0,0 |
| | | 234 | 0,0 |
| FINANS OCH FASTIGHET | | | |
| ABG Sundal Collier Holding (Annan finansiell verksamhet) | 58 326 | 347 | 0,0 |
| Aktia Bank (Bank) | 8 539 | 765 | 0,1 |
| Alm. Brand (Försäkring) | 16 153 | 1 728 | 0,1 |
| Atrium Ljungberg (Fastigheter) | 12 502 | 1 629 | 0,1 |
| Avanza (Annan finansiell verksamhet) | 2 820 | 970 | 0,1 |
| B2Holding (Annan finansiell verksamhet) | 34 609 | 724 | 0,1 |
| Balder B (Fastigheter) | 16 289 | 3 574 | 0,3 |
| BankNordik P/F (Bank) | 1 534 | 215 | 0,0 |
| Bure Equity (Annan finansiell verksamhet) | 6 176 | 607 | 0,1 |
| CapMan Plc B (Kapitalmarknadsbolag) | 14 542 | 253 | 0,0 |
| Castellum (Fastigheter) | 25 103 | 3 474 | 0,3 |
| Catella B (Kapitalmarknadsbolag) | 7 706 | 153 | 0,0 |
| Catena (Fastigheter) | 3 394 | 528 | 0,0 |
| Citycon (Fastigheter) | 85 267 | 1 809 | 0,2 |
| Collector (Bank) | 9 586 | 779 | 0,1 |
| Corem Property B (Fastigheter) | 54 098 | 250 | 0,0 |
| Creades (Annan finansiell verksamhet) | 1 216 | 362 | 0,0 |
| D. Carnegie & Co (Fastigheter) | 7 658 | 936 | 0,1 |
| Danske Bank (Bank) | 84 583 | 26 984 | 2,3 |
| Diös Fastigheter (Fastigheter) | 12 261 | 684 | 0,1 |
| DNB (Bank) | 146 989 | 22 379 | 1,9 |
| East Capital Explorer (Annan finansiell verksamhet) | 3 454 | 282 | 0,0 |
| Entra AS (Fastigheter) | 17 216 | 2 102 | 0,2 |
| EQ Ord Shs (Kapitalmarknadsbolag) | 4 008 | 327 | 0,0 |
| Evli Pankki Ord Shs (Kapitalmarknadsbolag) | 2 641 | 249 | 0,0 |
| Fabege (Fastigheter) | 15 311 | 2 673 | 0,2 |
| Fastighetspartner (Fastigheter) | 5 566 | 815 | 0,1 |
| Gjensidige Forsikring (Försäkring) | 45 425 | 7 043 | 0,6 |
| Gronlandsbanken Ord Shs (Bank) | 592 | 507 | 0,0 |
| Handelsbanken A (Bank) | 175 742 | 19 718 | 1,7 |
| Heba B (Fastigheter) | 4 925 | 545 | 0,0 |
| Helgeland Sparebank (Bank) | 3 001 | 264 | 0,0 |
| Hemfosa Fastigheter (Fastigheter) | 14 530 | 1 597 | 0,1 |
| Hoist Finance (Konsumentkrediter) | 7 156 | 660 | 0,1 |
| Hufvudstaden A (Fastigheter) | 19 809 | 2 603 | 0,2 |
| Industrivärden A (Annan finansiell verksamhet) | 39 206 | 8 296 | 0,7 |
| Jeurdan Ord Shs (Fastigheter) | 1 211 | 1 160 | 0,1 |
| Jutlander Bank Ord Shs (Bank) | 1 255 | 361 | 0,0 |
| Jyske Bank (Bank) | 8 159 | 3 805 | 0,3 |
| Kinnevik B (Annan finansiell verksamhet) | 24 953 | 6 919 | 0,6 |
| Klöver B (Fastigheter) | 86 037 | 922 | 0,1 |
| Komplett Bank (Bank) | 16 960 | 323 | 0,0 |
| Kungsleden (Fastigheter) | 20 297 | 1 208 | 0,1 |
| Latour B (Annan finansiell verksamhet) | 58 341 | 5 887 | 0,5 |
| Lundbergs B (Fastigheter) | 11 269 | 6 908 | 0,6 |
| Lån och Spar Bank A/S (Bank) | 244 | 156 | 0,0 |
| Nordax Group (Bank) | 9 349 | 495 | 0,0 |
| Nordea (Bank) | 365 324 | 36 277 | 3,1 |
| Nordjyske (Bank) | 3 053 | 484 | 0,0 |
| Norwegian Finans Holding (Bank) | 16 988 | 1 564 | 0,1 |
| Norwegian Property (Fastigheter) | 50 212 | 533 | 0,0 |
| NP3 Fastigheter (Fastigheter) | 5 939 | 309 | 0,0 |
| Olav Thon Eiendomsselskap (Fastigheter) | 10 469 | 1 708 | 0,1 |
| Oscar Properties (Fastigheter) | 2 148 | 74 | 0,0 |
| Pareto Bank ASA (Bank) | 7 200 | 285 | 0,0 |
| Platzer Fastigheter B (Fastigheter) | 11 084 | 576 | 0,0 |
| Protector Forsikring (Försäkring) | 8 053 | 725 | 0,1 |
| Ratos B (Kapitalmarknadsbolag) | 30 062 | 1 077 | 0,1 |
| Resurs (Konsumentkrediter) | 19 012 | 1 107 | 0,1 |
| Ringkjøbing Landbobank Ord Shs (Bank) | 2 399 | 1 018 | 0,1 |
| Sagax B (Fastigheter) | 14 916 | 1 465 | 0,1 |

Årsberättelse 2017 – Xact Kapitalförvaltning AB

Norden Index Criteria, forts.

| | Antal/Nom. bel. tusental | Marknads- värde tSEK | % av fondförm. | | Antal/Nom. bel. tusental | Marknads- värde tSEK | % av fondförm. |
|--|-----------------------------|-------------------------|-------------------|---|-----------------------------|-------------------------|-------------------|
| Treasure (Flygfrakt och kurirtjänst) | 23 284 | 336 | 0,0 | SÅLLANKÖPSVAROR OCH -TJÄNSTER | | | |
| Trelleborg B (Maskiner) | 24 720 | 4 697 | 0,4 | AcadeMedia (Diversifierad kundservice) | 10 650 | 690 | 0,1 |
| Troax Group A (Maskiner) | 1 749 | 487 | 0,0 | Alma Media (Media) | 7 721 | 546 | 0,0 |
| Uponor (Byggsvaror och -utrustning) | 6 643 | 1 096 | 0,1 | Amer Sports A (Fritidsvaror) | 10 661 | 2 420 | 0,2 |
| Valmet (Maskiner) | 13 537 | 2 188 | 0,2 | Autoliv (Bildelar och tillbehör) | 6 169 | 6 459 | 0,6 |
| VBG Group B (Maskiner) | 2 414 | 319 | 0,0 | Bakkafrost (Konsumentkapitalvaror) | 4 355 | 1 516 | 0,1 |
| Veidekke (Byggföretag) | 12 759 | 1 185 | 0,1 | Bang&Olufsen B (Konsumentkapitalvaror) | 4 107 | 811 | 0,1 |
| Vestas Wind Systems (Elutrustningar) | 19 409 | 10 990 | 0,9 | Bilia A (Specialdetaljhandel) | 9 827 | 786 | 0,1 |
| Wilh. Wilhelmsen (Rederi) | 38 106 | 2 260 | 0,2 | Bonava (Konsumentkapitalvaror) | 9 920 | 1 137 | 0,1 |
| Wilh. Wilhelmsen Holding (Rederi) | 4 321 | 1 071 | 0,1 | Boozt | | | |
| Volvo B (Maskiner) | 191 619 | 29 260 | 2,5 | (Kläder, skor, accessoarer och lyxvaror) | 5 113 | 375 | 0,0 |
| Wärtsilä (Maskiner) | 17 804 | 9 207 | 0,8 | Bufab (Bildelar och tillbehör) | 3 487 | 370 | 0,0 |
| Xano (Maskiner) | 1 385 | 207 | 0,0 | Byggmax Group (Specialdetaljhandel) | 6 147 | 338 | 0,0 |
| YIT (Byggföretag) | 11 929 | 747 | 0,1 | CDON (Media) | 14 479 | 262 | 0,0 |
| ÅF B (Företagstjänster) | 7 341 | 1 328 | 0,1 | Clas Ohlson B (Specialdetaljhandel) | 6 261 | 704 | 0,1 |
| | | 313 944 | 27,0 | Dometic Group (Konsumentkapitalvaror) | 26 785 | 2 238 | 0,2 |
| INFORMATIONSTEKNIK | | | | Dustin Group (Internethandel och postorder) | 6 693 | 545 | 0,0 |
| Acando B (IT-konsult) | 9 666 | 270 | 0,0 | Ekornes (Konsumentkapitalvaror) | 3 103 | 368 | 0,0 |
| Addnode B (IT-konsult) | 2 671 | 202 | 0,0 | Elanders B (Media) | 3 649 | 299 | 0,0 |
| Asetek Ord Shs (Datorer och kringutrustning) | 1 772 | 186 | 0,0 | Electrolux B (Konsumentkapitalvaror) | 27 714 | 7 325 | 0,6 |
| Atea (IT-konsult) | 9 873 | 1 141 | 0,1 | Europris (Varuhus) | 14 882 | 498 | 0,0 |
| Basware (Programvaror) | 1 384 | 646 | 0,1 | Fenix Outdoor B (Specialdetaljhandel) | 850 | 829 | 0,1 |
| Bouvet (IT-konsult) | 1 272 | 260 | 0,0 | FinnvedenBulten (Bildelar och tillbehör) | 2 152 | 264 | 0,0 |
| CLX Communications (Programvaror) | 4 554 | 329 | 0,0 | Fiskars (Konsumentkapitalvaror) | 7 595 | 1 789 | 0,2 |
| Columbus IT Partner (IT-konsult) | 11 283 | 221 | 0,0 | Handicare Grp (Bildelar och tillbehör) | 5 287 | 279 | 0,0 |
| Elektrobit (Programvaror) | 3 616 | 201 | 0,0 | Hennes & Mauritz B (Specialdetaljhandel) | 149 189 | 25 258 | 2,2 |
| ENEA Ord Shs1 (IT-konsult) | 1 784 | 145 | 0,0 | Husqvarna B (Konsumentkapitalvaror) | 51 519 | 4 024 | 0,3 |
| Ericsson B | | | | IC Companys | | | |
| (Data- och telekommunikationsutrustning) | 300 228 | 16 167 | 1,4 | (Kläder, skor, accessoarer och lyxvaror) | 1 597 | 307 | 0,0 |
| eWork Scandinavia (IT-konsult) | 1 975 | 209 | 0,0 | Internationella Engelska Skolan i Sveri | | | |
| Evry (IT-konsult) | 35 937 | 1 169 | 0,1 | (Diversifierad kundservice) | 4 930 | 370 | 0,0 |
| Fingerprint Cards B (Elektronikutrustning) | 26 718 | 422 | 0,0 | JM (Konsumentkapitalvaror) | 6 397 | 1 196 | 0,1 |
| F-Secure (Programvaror) | 13 859 | 530 | 0,0 | Kabe B (Fritidsvaror) | 835 | 148 | 0,0 |
| G5 Entertainment (Programvaror) | 814 | 259 | 0,0 | Kamux Ord Shs (Bilar och motorcyklar) | 4 286 | 297 | 0,0 |
| HMS Network AB (Elektronikutrustning) | 4 057 | 503 | 0,0 | KappAhl (Specialdetaljhandel) | 6 947 | 315 | 0,0 |
| I.A.R. Systems Group B (Programvaror) | 1 142 | 216 | 0,0 | Kid Ord Shs (Specialdetaljhandel) | 4 993 | 222 | 0,0 |
| I dex (Elektronikutrustning) | 50 457 | 261 | 0,0 | Kongsberg Automotive Holding | | | |
| Knowit (IT-konsult) | 1 765 | 274 | 0,0 | (Bildelar och tillbehör) | 38 483 | 453 | 0,0 |
| Lagercrantz B (Elektronikutrustning) | 6 448 | 522 | 0,0 | Mekonomen (Specialdetaljhandel) | 3 225 | 481 | 0,0 |
| Micronic MYDATA (Elektronikutrustning) | 9 061 | 770 | 0,1 | MIPS (Fritidsvaror) | 1 991 | 102 | 0,0 |
| Net Insight B | | | | Modern Times Group B (Media) | 6 079 | 2 096 | 0,2 |
| (Data- och telekommunikationsutrustning) | 34 361 | 163 | 0,0 | New Wave Group B | | | |
| Nets Ord Shs (IT-konsult) | 18 118 | 3 904 | 0,3 | (Kläder, skor, accessoarer och lyxvaror) | 6 197 | 338 | 0,0 |
| Nokia | | | | Nobia (Specialdetaljhandel) | 15 722 | 1 091 | 0,1 |
| (Data- och telekommunikationsutrustning) | 525 539 | 20 120 | 1,7 | Nokian Tyres (Bildelar och tillbehör) | 12 445 | 4 625 | 0,4 |
| Nolato B | | | | Oriola-KD (Partihandel) | 18 227 | 502 | 0,0 |
| (Data- och telekommunikationsutrustning) | 2 400 | 1 294 | 0,1 | Pandox B (Hotell, restauranger och fritid) | 14 374 | 2 278 | 0,2 |
| Nordic Semiconductor (Elektronikutrustning) | 14 438 | 607 | 0,1 | Rezidor Hotel Group | | | |
| Opera Software (Internet) | 14 342 | 376 | 0,0 | (Hotell, restauranger och fritid) | 16 597 | 425 | 0,0 |
| Opus Group (Elektronikutrustning) | 28 328 | 184 | 0,0 | Sanoma (Media) | 14 831 | 1 585 | 0,1 |
| Proact IT Group (IT-konsult) | 766 | 138 | 0,0 | Scandic Hotels Group | | | |
| Rovio Entertainment Corporation | | | | (Hotell, restauranger och fritid) | 9 424 | 1 110 | 0,1 |
| (Programvaror) | 7 215 | 641 | 0,1 | Schibsted (Media) | 21 528 | 5 056 | 0,4 |
| Rtx Telecom | | | | Skistar B (Hotell, restauranger och fritid) | 3 478 | 550 | 0,0 |
| (Data- och telekommunikationsutrustning) | 1 035 | 202 | 0,0 | Stockmann B (Konsumentkapitalvaror) | 7 614 | 326 | 0,0 |
| Scanfil (Elektronikutrustning) | 6 567 | 274 | 0,0 | Thule Group (Fritidsvaror) | 9 174 | 1 696 | 0,1 |
| SimCorp (Programvaror) | 3 632 | 1 694 | 0,1 | Tokmanni Group Corporation Ord Shs | | | |
| Starbreeze (Programvaror) | 27 157 | 228 | 0,0 | (Varuhus) | 5 272 | 376 | 0,0 |
| Thin Film Electronics | | | | XXL (Specialdetaljhandel) | 12 753 | 1 085 | 0,1 |
| (Datorer och kringutrustning) | 113 109 | 281 | 0,0 | | | 87 156 | 7,5 |
| Tieto EUR (IT-konsult) | 6 651 | 1 699 | 0,1 | TELEKOMOPERATÖRER | | | |
| Tobii Technology (Programvaror) | 8 532 | 302 | 0,0 | Com Hem (Teleoperatör) | 16 655 | 2 089 | 0,2 |
| Vaisala (Elektronikutrustning) | 1 668 | 730 | 0,1 | DNA Ord Shs (Teleoperatör) | 12 432 | 1 913 | 0,2 |
| Vitec Software Group B (Programvaror) | 3 820 | 332 | 0,0 | Elisa (Teleoperatör) | 15 208 | 4 892 | 0,4 |
| | | 58 074 | 5,0 | Invisio Communications (Teleoperatör) | 4 135 | 328 | 0,0 |
| KRAFTFÖRSÖRJNING | | | | Link Mobility Group Ord Shs | | | |
| Arendals (Oberoende kraftbolag) | 212 | 658 | 0,1 | (Mobilteleoperatör) | 1 165 | 169 | 0,0 |
| Besqab (Diversifierat infrastrukturbolag) | 1 637 | 189 | 0,0 | Millicom (Mobilteleoperatör) | 8 672 | 4 804 | 0,4 |
| Scatec Solar (Oberoende kraftbolag) | 9 368 | 469 | 0,0 | TDC (Teleoperatör) | 73 866 | 3 719 | 0,3 |
| | | 1 316 | 0,1 | Tele2 B (Teleoperatör) | 45 616 | 4 598 | 0,4 |
| MATERIAL | | | | Telenor (Teleoperatör) | 135 480 | 23 855 | 2,0 |
| Afarak Group Ord Shs (Metaller och gruvor) | 25 274 | 210 | 0,0 | TeliaSonera (Teleoperatör) | 392 651 | 14 351 | 1,2 |
| BillerudKorsnäs (Förpackningar) | 18 632 | 2 618 | 0,2 | | | 60 717 | 5,2 |
| Boliden (Metaller och gruvor) | 24 814 | 6 963 | 0,6 | ÖVRIGT | | | |
| Borregaard (Kemi) | 8 699 | 710 | 0,1 | Pandora (Övrigt) | 10 162 | 9 064 | 0,8 |
| Broedrene Hartmann B Ord Shs | | | | United International Enterprises (Övrigt) | 421 | 722 | 0,1 |
| (Förpackningar) | 711 | 300 | 0,0 | | | 9 786 | 0,9 |
| Christian Hansen Holding (Kemi) | 11 979 | 9 206 | 0,8 | Summa noterade aktier | 1 149 082 | 98,7 | |
| Gränges (Kemi) | 7 173 | 604 | 0,1 | Summa överlåtbara värdepapper | 1 149 082 | 98,7 | |
| Hexpol B (Kemi) | 31 091 | 2 585 | 0,2 | | | | |
| Holmen B (Papper och skogsprodukter) | 7 560 | 3 296 | 0,3 | | | | |
| Huhtamäki (Förpackningar) | 9 638 | 3 316 | 0,3 | | | | |
| Kemira (Kemi) | 14 334 | 1 621 | 0,1 | | | | |
| Lindab International (Byggmaterial) | 6 470 | 441 | 0,0 | | | | |
| Lucara Diamond (Metaller och gruvor) | 10 886 | 198 | 0,0 | | | | |
| Lundin Mining (Metaller och gruvor) | 6 581 | 362 | 0,0 | | | | |
| Metsä Board (Papper och skogsprodukter) | 31 741 | 2 230 | 0,2 | | | | |
| Munksjö (Papper och skogsprodukter) | 8 592 | 1 535 | 0,1 | | | | |
| Nickel Mountain Group (Metaller och gruvor) | 131 816 | 379 | 0,0 | | | | |
| Norsk Hydro (Metaller och gruvor) | 187 717 | 11 716 | 1,0 | | | | |
| Novozymes (Kemi) | 27 638 | 12 938 | 1,1 | | | | |
| Outokumpu (Metaller och gruvor) | 37 871 | 2 882 | 0,2 | | | | |
| SCA B (Papper och skogsprodukter) | 63 194 | 5 343 | 0,5 | | | | |
| SP Group (Kemi) | 208 | 301 | 0,0 | | | | |
| SSAB B (Metaller och gruvor) | 93 838 | 3 435 | 0,3 | | | | |
| Stora Enso R EUR | | | | | | | |
| (Papper och skogsprodukter) | 70 925 | 9 218 | 0,8 | | | | |
| Tikkurila (Kemi) | 4 045 | 708 | 0,1 | | | | |
| UPM-Kymmene | | | | | | | |
| (Papper och skogsprodukter) | 48 026 | 12 234 | 1,1 | | | | |
| Yara International (Kemi) | 24 626 | 9 286 | 0,8 | | | | |
| | | 104 635 | 9,0 | | | | |

Årsberättelse 2017 – Xact Kapitalförvaltning AB

Norden Index Criteria, forts.

ÖVRIGA FINANSIELLA INSTRUMENT***

| | Antal/Nom. bel. tusental | Marknads- värde tSEK | % av fondförm. |
|--|-----------------------------|-------------------------|-------------------|
| FON DANDELAR | | | |
| BÖRSHANDELADE AKTIEFONDER** | | | |
| XACT Högutdelande (Sverige och Norden) | 41 832 | 4 546 | 0,4 |
| XACT Norden 30 (Sverige och Norden) | 79 640 | 8 853 | 0,8 |
| XACT Svenska Småbolag (Sverige och Norden) | 11 708 | 1 632 | 0,1 |
| | | 15 031 | 1,3 |
| Summa fondandelar | | 15 031 | 1,3 |
| Summa övriga finansiella instrument | | 15 031 | 1,3 |
| Summa innehav av finansiella instrument | | 1 164 113 | 100,0 |
| Netto, övriga tillgångar och skulder | | 592 | 0,0 |
| Total summa fondförmögenhet | | 1 164 705 | 100,0 |

Siffrorna i kolumnen med rubriken % av fondförmögenheten är avrundade till närmaste tiondels procent.

* Avser överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES, eller som är föremål för regelbunden handel vid någon annan marknad som är reglerad och öppen för allmänheten. 98,7

** Avser övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES, eller som är föremål för regelbunden handel vid någon annan marknad som är reglerad och öppen för allmänheten och såvitt avser penningmarknadsinstrument, alternativt sådana penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 4 § lagen (2004:46) om värdepappersfonder. 1,3

*** Avser övriga finansiella instrument. -

Sammanställning, företags- och koncernexponeringar*

| Företag/koncern | % av fondförmögenheten | Företag/koncern | % av fondförmögenheten |
|-----------------|------------------------|------------------|------------------------|
| Handelsbanken | 2,6 | SpareBank 1 | 0,3 |
| | | Wilh. Wilhelmsen | 0,3 |

* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Tilläggsupplysningar om utlånade värdepapper

Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar **5,34**

De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

| | |
|----------------------|--------|
| Brittiska Staten | 23 806 |
| Franska Staten | 19 906 |
| Tyska Staten | 8 578 |
| Österrikiska Staten | 674 |
| Akzo Nobel NV | 674 |
| Nestle SA | 641 |
| Tencent Holdings Ltd | 610 |
| Vinci SA | 589 |
| Volvo AB | 543 |
| Toyota Motor Corp | 456 |

De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

| | |
|--|---------------|
| J.P. Morgan Securities Plc, Storbritannien | 48 096 |
| Citigroup Global Markets Ltd, Storbritannien | 14 023 |
| | 62 119 |

Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

| | |
|--|---------------|
| Aktier | 13 949 |
| Obligationer och andra räntebärande instrument | 53 086 |
| | 67 035 |

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

| | |
|-------------------------|---------------|
| Mindre än en dag | 0 |
| En dag till en vecka | 0 |
| En vecka till en månad | 123 |
| En till tre månader | 0 |
| Tre månader till ett år | 3 328 |
| Mer än ett år | 49 635 |
| Obestämd löptid | 13 949 |
| | 67 035 |

Säkerheternas valuta tSEK:

| | |
|-----|---------------|
| AUD | 282 |
| CHF | 641 |
| DKK | 47 |
| EUR | 32 504 |
| GBP | 24 694 |
| HKD | 3 142 |
| JPY | 3 369 |
| SEK | 920 |
| SGD | 10 |
| USD | 1 426 |
| | 67 035 |

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

Avveckling och clearing av värdepapperslånen sker med tredje part.

De mottagna säkerheterna förvaras hos JP Morgan Chase Bank N.A. (London Branch) och återanvänds ej.

Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 74 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% JP Morgan Bank N.A. (London Branch) i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

Motparter för värdepappersutlåning under året:

-Citigroup Global Markets Ltd

-J.P. Morgan Securities Plc

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av SIX Financial Information AB ("SIX") och SIX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av SIX SRI Nordic Index NI kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. SIX skall i intet fall vara ansvarig för fel i SIX SRI Nordic Index NI. SIX skall ej heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i SIX SRI Nordic Index NI. Alla rättigheter till varumärket SIX SRI Nordic Index NI tillhör SIX och används enligt licens från SIX.