

XACT OMXS30 (UCITS ETF)

Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen

Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet OMXS30™ så nära som möjligt. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på OMX Nordic Exchange Stockholm. Fonden placerar i aktier som ingår i detta index. För att skydda fondens värde eller för att spara kostnader kan vi som komplement använda derivat såsom terminer.

Portföljen

XACT OMXS30™ steg med 9,0% under första halvåret 2017*. Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet. Vid halvårsskiftet var de tre största innehaven Nordea, Atlas Copco och H&M. NASDAQ OMXS30™ omviktas två gånger per år: sista juni och sista december. SCA delade ut Essity som från och med den 12 juni ingår i index, som då för tillfället består av 31 aktier.

*) 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 och låna in aktier. Under 2017 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument.

Under 2017 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

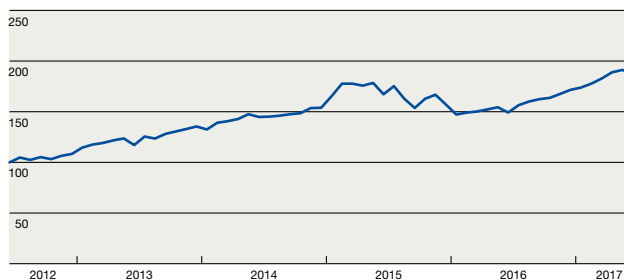
Information

Den 20 januari 2017 ändrades fondens fondbestämmelser. Derivat får nu handlas som ett led i fondens placeringsinriktning

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

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

Fondens utveckling*



* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008
Andelsvärde, SEK	185,55	170,31	155,94	152,73	134,42	107,48	94,27	112,63	93,76	66,12
Fondens totala nettovärde, mnSEK	157	-162	-187	-3 179	566	358	-	-	-	-
Fondförmögenhet, mnSEK	11 495	10 380	9 754	9 821	11 668	8 873	7 443	7 372	5 251	4 421
Antal andelar, tusental	61 950	60 950	62 550	64 300	86 800	82 550	78 950	65 450	56 000	66 850
Total avkastning i %	+9,0	+9,2	+2,1	+13,6	+25,1	+16,0	-11,9	+24,5	+49,1	-36,5
Index inklusive utdelning i %	+8,9	+9,4	+2,2	+14,0	+25,5	+16,3	-11,6	+24,9	+49,1	-36,3
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	+5,7	+5,6	+7,7	+19,2	+20,4	+1,1	+4,7	+36,2	-2,7	-21,7
Motsvarande för index inklusive utdelning, %	+5,8	+5,8	+7,9	+19,6	+20,8	+1,4	+5,1	+36,5	-2,5	-21,4
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	+13,3	+12,9	+8,2	+12,6	+18,9	+3,8	+0,1	+6,9	+8,3	+3,5
Motsvarande för index inklusive utdelning, %	+13,6	+13,2	+8,5	+12,9	+19,2	+4,1	+0,4	+7,2	+8,6	+3,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	+6,0	+6,3	+7,5	+10,4	+10,9	+11,6	+4,5	+3,6	-	-
Motsvarande för index inklusive utdelning, %	+6,3	+6,6	+7,8	+10,8	+11,3	+12,0	+4,7	+3,7	-	-
Utdelning per andel, kr	-	-	-	-	-	1,64	5,60	3,44	3,90	4,00

Index: OMXS30™ Gross Index

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

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

Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,30
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,10
Årlig avgift, %	0,10
Analyskostnader, tSEK ¹⁾	-
Transaktionskostnader, tSEK	226
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

1) Från 1 januari 2015 debiteras kostnader för extern analys separat. Denna kostnad ingick tidigare i transaktionskostnader. För mer info se Definitioner.

Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,4
Andel av oms. som skett genom närstående värdepappersinstitut, %	8,1
Andel av oms. som skett med fonder förvaldade av Xact Kapitalförvaltning AB, %	0,0

Risk- och avkastningsmått*

Total risk %	12,8	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	12,7	Sharpekvot	0,5
Aktiv risk %	0,1	Sharpekvot i index	0,5
Index	OMXS30™ Gross Index		
Aktiv avkastning %	-0,1		

* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden.

Halvårsredogörelse 2017 – Xact Kapitalförvaltning AB

XACT OMXS30 (UCITS ETF), forts.

Balansräkning, tSEK

	30 jun 2017	% av fondförm.	31 dec 2016	% av fondförm.
TILLGÅNGAR				
Överlåtbara värdepapper	11 494 418	100,0	10 377 480	100,0
Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde ^{Not 1)}	11 494 418	100,0	10 377 480	100,0
Bankmedel och övriga likvida medel	565	0,0	689	0,0
Övriga tillgångar	53 291	0,5	213 078	2,0
Summa tillgångar	11 548 274	100,5	10 591 247	102,0
SKULDER				
Upplypna kostnader och förutbetalda intäkter	486	0,0	460	0,0
Övriga skulder	52 880	0,5	210 509	2,0
Summa skulder	53 366	0,5	210 969	2,0
Fondförmögenhet	11 494 908	100,0	10 380 278	100,0

Not 1) till balansräkning

Fondens innehav av finansiella instrument

ÖVERLÅTBARA VÄRDEPAPPER*

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
NOTERADE AKTIER			
DAGLIGVAROR			
Essity B (Hushållsprodukter)	1 802 745	415 533	3,6
Swedish Match (Tobak)	514 185	152 559	1,3
		568 092	4,9
ENERGI			
Lundin Petroleum (Olja och gas)	961 464	155 853	1,4
		155 853	1,4
FINANS OCH FASTIGHET			
Handelsbanken A (Bank)	5 394 606	650 589	5,7
Investor B (Annan finansiell verksamhet)	1 287 321	522 652	4,5
Kinnevik B (Annan finansiell verksamhet)	661 626	170 633	1,5
Nordea (Bank)	11 444 643	1 226 866	10,7
SEB A (Bank)	6 131 811	624 832	5,4
Swedbank A (Bank)	3 199 098	656 775	5,7
		3 852 347	33,6
HÄLSOVÅRD			
AstraZeneca SDB (Läkemedel)	370 461	211 904	1,8
Getinge B (Hälsovårdsutrustning)	628 173	103 586	0,9
		315 489	2,7
INDUSTRIVAROR OCH –TJÄNSTER			
ABB SDB (Elutrustningar)	1 414 938	296 005	2,6
Alfa Laval (Maskiner)	1 185 723	204 419	1,8
Assa Abloy B (Byggvaror och -utrustning)	2 981 034	551 789	4,8
Atlas Copco A (Maskiner)	2 371 446	765 977	6,7
Atlas Copco B (Maskiner)	1 102 710	320 999	2,8
Sandvik (Maskiner)	3 544 779	469 683	4,1
Securitas B (Företagstjänster)	983 766	139 695	1,2
Skanska B (Byggföretag)	1 131 207	226 128	2,0
SKF B (Maskiner)	1 184 484	202 191	1,8
Volvo B (Maskiner)	4 623 948	663 999	5,8
		3 840 886	33,5
INFORMATIONSTEKNIK			
Ericsson B (Data- och telekommunikationsutrustning)	8 682 912	523 145	4,6
Fingerprint Cards B (Elektronikutrustning)	869 778	26 763	0,2
		549 909	4,8
MATERIAL			
Boliden (Metaller och gruvor)	773 136	177 744	1,5
SCA B (Papper och skogsprodukter)	1 802 745	114 925	1,0
SSAB A (Metaller och gruvor)	859 866	33 062	0,3
		325 731	2,8
SÄLLANKÖPSVAROR OCH –TJÄNSTER			
Autoliv (Bil delar och tillbehör)	205 674	190 043	1,7
Electrolux B (Konsumentkapitalvaror)	849 954	234 672	2,0
Hennes & Mauritz B (Specialdetaljhandel)	4 128 348	866 540	7,5
		1 291 255	11,2
TELEKOMOPERATÖRER			
Tele2 B (Teleoperatör)	1 362 900	120 208	1,0
TeliaSonera (Teleoperatör)	12 236 364	474 649	4,1
		594 856	5,1
Summa noterade aktier		11 494 418	100,0
Summa överlåtbara värdepapper		11 494 418	100,0
Summa innehav av finansiella instrument		11 494 418	100,0
Netto, övriga tillgångar och skulder		490	0,0
Total summa fondförmögenhet		11 494 908	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. 100,0

** 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. -

*** Avser övriga finansiella instrument. -

Sammanställning, företags- och koncernexponeringar*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Atlas Copco	9,5

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