

SELIGSON & CO SUOMI INDEKSIRAHASTO PUOLIVUOSIKATSAUS 30.6.2018

OSUUSLAJIT A ja B | ISIN KOODIT FI0008801758 (A / kasvu) ja FI0008801766 (B / tuotto)
Rahastoa hallinnoi Seligson & Co Rahastoyhtiö Oyj, joka on Seligson & Co Oyj:n täysin omistama tytäryhtiö.

SIJOITUSPOLITIikka

Rahasto sijoittaa Suomen osakemarkkinoille. Sen tavoitteena on antaa sijoittajalle tuotto, joka mahdollisimman hyvin vastaa OMX GES Finland Sustainability -osakeindeksin tuottoa. Indeksia seurataan pääasiallisesti sijoittamalla suoraan indeksin sisältämiin osakkeisiin. Katsauskauden aikana rahaston sijoituskohteissa ei tapahtunut muita kuin rahaston normaalin sijoituspolitiikan mukaisia muutoksia. Johdannaisten käyttö on vähäistä eikä niillä ole olennaista vaikutusta rahaston riskiprofiiliin. Tarkemmat salkunhoitajan katsaukset rahaston sijoituksiin löytyvät Rahastoyhtiön julkaisemasta neljännesvuosikatsauksesta.

ARVONKEHITYS (aloituspäivästä)



RAHASTON TIEDOT 30.6.2018

| | |
|---------------------------|-------------|
| NETTOVARALLISUUS € | 150 803 374 |
| Varat € | 150 865 101 |
| Velat € | 61 727 |
| OSUUDENOMISTAJIA | 11 525 |

PALKKIOT

| | |
|---|---|
| Rahastoyhtiölle maksettava merkintä- / lunastuspalkkio | ei |
| Rahastoon maksettava kaupankäyntipalkkio | 0,1 % merkittäessä ja lunastettaessa 0,5 % lunastettaessa, jos sijoitusaika < 180 pv |
| Rahastoyhtiölle maksettava hallinnointi- ja säilytyspalkkio | 0,45 % p.a. |
| Rahastoyhtiölle maksettava tuottosidonnainen palkkio | Ei |
| Rahastoyhtiölle maksetut hallinnointipalkkiot 1-6/2018, eur | 313 075 |
| Säilytysyhteisölle maksetut palkkiot 1-6/2018, eur | 3 152 |

Tässä puolivuotiskatsauksessa julkaistut luvut perustuvat rahaston arvonlaskentahetkeen. Tämän katsauksen lisäksi rahastosta julkaistaan vuosikertomus, avaintieto- ja rahastoesite, joka sisältää myös rahaston säännöt. Näiden virallisten esitteiden lisäksi Seligson & Co Rahastoyhtiö julkaisee rahastojen neljännesvuosikatsauksen, joka sisältää mm. uusimmat tunnusluvut sekä rahastosijoittamiseen liittyviä artikkeleita. Esitteet ja katsaukset on saatavissa joko tilaamalla Seligson & Co Rahastoyhtiöstä tai ladattavissa internet-sivuiltamme. Suosittelemme tutustumista esitteisiin ennen sijoituspäätöstä.

ARVOPAPERISIJOITUSTEN JA JOHDANNAISSOPIMUSTEN RYHMITTELY 30.6.2018

| Arvopaperit, joilla käydään julkisesti kauppaa arvopaperipörssin pörssilistalla | | | | |
|---|-----------|--------|---------------|--------------------|
| Arvopaperi | Kpl | Kurssi | Markkina-arvo | Rahaston arvosta % |
| KONE OYJ-B | 361 924 | 43,520 | 15 750 932,48 | 10,4 |
| NOKIA OYJ | 3 102 503 | 4,931 | 15 298 442,29 | 10,1 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 364 200 | 41,780 | 15 216 276,00 | 10,1 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 487 990 | 30,680 | 14 971 533,20 | 9,9 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 765 105 | 16,745 | 12 811 683,23 | 8,5 |
| FORTUM OYJ | 449 306 | 20,500 | 9 210 773,00 | 6,1 |
| NESTE OYJ | 132 369 | 66,960 | 8 863 428,24 | 5,9 |
| WÄRTSILA OYJ | 439 313 | 16,715 | 7 343 116,80 | 4,9 |
| ELISA OYJ | 146 398 | 39,510 | 5 784 184,98 | 3,8 |
| KESKO OYJ-B SHS | 102 983 | 52,280 | 5 383 951,24 | 3,6 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 134 261 | 33,740 | 4 529 966,14 | 3,0 |
| METSO OYJ | 123 820 | 28,410 | 3 517 726,20 | 2,3 |
| ORION OYJ-CLASS B | 145 417 | 23,210 | 3 375 128,57 | 2,2 |
| HUHTAMÄKI OYJ | 98 731 | 31,340 | 3 094 229,54 | 2,1 |
| AMER SPORTS OYJ | 113 952 | 26,640 | 3 035 681,28 | 2,0 |
| KONECRANES OYJ | 73 915 | 34,860 | 2 576 676,90 | 1,7 |
| METSÄ BOARD OYJ | 226 916 | 9,680 | 2 196 546,88 | 1,5 |
| VALMET OYJ | 129 599 | 16,360 | 2 120 239,64 | 1,4 |
| CARGOTEC OYJ-B SHARE | 48 600 | 42,860 | 2 082 996,00 | 1,4 |
| TIETO OYJ | 68 609 | 27,940 | 1 916 935,46 | 1,3 |
| OUTOKUMPU OYJ | 329 320 | 5,312 | 1 749 347,84 | 1,2 |
| KEMIRA OYJ | 104 213 | 11,340 | 1 181 775,42 | 0,8 |
| FISKARS OYJ ABP | 51 605 | 19,300 | 995 976,50 | 0,7 |
| OUTOTEC OYJ | 133 245 | 6,814 | 907 931,43 | 0,6 |
| CRAMO OYJ | 42 600 | 19,800 | 843 480,00 | 0,6 |
| SANOMA OYJ | 85 585 | 8,770 | 750 580,45 | 0,5 |
| RAMIRENT OYJ | 78 900 | 8,985 | 708 916,50 | 0,5 |
| VAISALA OYJ- A SHS | 26 742 | 21,400 | 572 278,80 | 0,4 |
| LASSILA & TIKANOJA OYJ | 33 677 | 16,200 | 545 567,40 | 0,4 |
| CAVERION OYJ | 88 549 | 6,050 | 535 721,45 | 0,4 |

ARVOPAPERISIJOITUSTEN JA JOHDANNAISSOPIMUSTEN RYHMITTELY 30.6.2018

| Arvopaperi | Kpl | Kurssi | Markkina-arvo | Rahaston arvosta % |
|--|-----------------|--------|-----------------------|--------------------|
| FINNAIR OYJ | 58 228 | 9,185 | 534 824,18 | 0,4 |
| CITYCON OYJ | 271 406 | 1,844 | 500 472,66 | 0,3 |
| TIKKURILA OYJ | 30 567 | 14,700 | 449 334,90 | 0,3 |
| BASWARE OYJ | 11 594 | 35,100 | 406 949,40 | 0,3 |
| TECHNOPOLIS OYJ | 98 074 | 3,830 | 375 623,42 | 0,2 |
| STOCKMANN OYJ ABP-B SHARE | 54 867 | 4,000 | 219 468,00 | 0,1 |
| ALMA MEDIA OYJ | 32 232 | 6,580 | 212 086,56 | 0,1 |
| SUOMINEN OYJ | 24 371 | 3,360 | 81 886,56 | 0,1 |
| EXEL COMPOSITES OYJ | 11 900 | 5,760 | 68 544,00 | 0,0 |
| Arvopaperit yhteensä | | | 150 721 213,54 | 99,9 |
| Salkku yhteensä | | | 150 721 213,54 | 99,9 |
| Kassa ja muut varat, netto | | | 82 160,93 | 0,1 |
| RAHASTON ARVO YHTEENSÄ | | | 150 803 374,47 | 100 |
| Liikkeessä olevien osuuksien lukumäärä, kasvuosuus (A) | 17 271 005,2509 | | | |
| Liikkeessä olevien osuuksien lukumäärä, tuotto-osuus (B) | 344 409,8409 | | | |
| Rahasto-osuuden arvo, kasvuosuus (A) | 8,6517 | | | |
| Rahasto-osuuden arvo, tuotto-osuus (B) | 4,0062 | | | |

OSAKELAINAT 30.6.2018

| | |
|---|--------------|
| Osakelainasopimukset € | 1 479 354,24 |
| - lainattavissa olevista varoista | 0,98 % |
| - koko varallisuudesta | 0,98 % |
| Vakuus € | 1 955 922,13 |
| - osakelainoista | 132,21 % |
| Vakuuksien liikkeeseenlaskijat | |
| - Saksan valtio € | 1 366 105,64 |
| - Hollannin valtio € | 589 816,49 |
| Vastapuolet | |
| - LAGO Kapital Oy € | 1 479 354,24 |
| Vakuuden tyyppi, valuutta ja maturiteetti | |
| - valtion joukkolainat EUR | 1 955 922,13 |
| - maturiteetti yli 1 v, € | 1 955 922,13 |
| Osakelainojen maturiteetti: avoin (alle 1 vuosi) | 100 % |
| Selvitys: kahdenvälinen | 100 % |

| | |
|---|--------------|
| Vakuuden säilyttäjä: OP Yrityspankki | |
| - säilytyksessä oleva vakuus € | 1 955 922,13 |
| - säilytys S&Co rahastojen yhteisessä säilytyksessä | 100 % |
| Osakelainojen tuotot 1.1.- 30.6.2018 lainojen kokonaistuotosta | € |
| Rahaston saama tuotto 75 % | 5 441,26 |
| Aiheutuneet kulut (vastapuolelle maksettu korvaus) 25 % | 1 813,75 |

TUNNUSLUVUT JA SIOITUSTEN JAKAUMA 30.6.2018

| KULUT JA MUUT TUNNUSLUVUT | 1.7.2017 – 30.6.2018 |
|---|----------------------|
| Juoksevat kulut (ei sisällä kaupankäyntikuluja) | 0,46 % |
| Tuottosidonnainen palkkio (vuoden alusta) | - |
| Kaupankäyntikulut | 0,02 % |
| Kokonaiskulut (ml. kaupankäyntikulut) | 0,49 % |
| Salkun kiertonopeus | 31,63 % |
| Välityspalkkiot lähipiirille | 0,00 % |
| Indeksipoikkeama (tracking error) | 0,14 % |
| Sharpen mittari | 0,77 |

| SIOITUSTEN TOIMIALAJAKAUMA | Osuus % |
|----------------------------|---------|
| Teollisuus | 61,16 |
| Teknologia | 15,53 |
| Rahoitus | 10,68 |
| Kulutustavarat | 10,39 |
| Terveys | 2,24 |

Kaupankäyntikulu on tässä laskettu Sijoitusrahastoyhdistyksen suosituksen mukaisesti eli siten, että edeltävän vuoden euromääräiset kaupankäyntikulut on jaettu rahaston kyseisen 12 kuukauden jakson korkeimmalla pääomalla. Julkaisemme rahastojemme neljännesvuosittaisessa katsauksessa myös luvun, jossa euromääräiset kulut on jaettu tarkastelujakson keskimääräisellä rahastopääomalla. Myös tässä julkaistu kokonaiskulu (TKA) on laskettu käyttäen keskimääräiseen rahastopääomaan perustuvaa lukua.